(上接C223版)
法定代表人:张华东
联系人:徐翔
电话:025-83367888-4201
传真:022-83320066
客户服务热线:4008285888
公司网站:www.njzq.com.cn
(74)名称: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A座三层、五层
法定代表人:丁之锁
联系人:陶颖
电话:010-58568040
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn
(75)名称:浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人:吴承
联系人:谢项辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客服电话:0571-967777
公司网站:www.stocke.com.cn
(76)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
联系人:陈诚
电话:023-63786464
传真:023-63786311
客服电话:4008-096-096
公司网站:www.swsc.com.cn
(77)名称: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号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
电话:0871-3577398
传真:0871-3578827
公司网站:www.hongtazq.com
(78)名称:国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:金喆
电话:028-86690126
传真:028-86690126
客服电话:4006600109
公司网站:www.gjzq.com.cn
(79)名称:联讯证券有限责任公司
注册地址:广东省惠州市下埔路14号
法定代表人:徐刚
客服电话:400-8888-929
联系人:丁宁
电话:010-64408820
传真:010-64408252
公司网站:www.lxzq.com.cn
(80)名称:新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
办公地址:北京市西城区金融大街1号A座8层
法人代表:马金声
联络人:孙恺
联系电话:010-83561149
客服电话:400-698-9898
传真:010-83561094
网址:www.xsdzq.cn
(81)名称: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
联系人:陈韦杉
联系电话:010-88086830-730 010-88086830-737
传真:010-66412537
客服电话:010-88086830
公司网址:www.rxzq.com.cn
3、其他代销机构
本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
法定代表人:王志伟
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华
(三)、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师集团(广州)事务所
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:程秉 黄贞
联系人:程秉
(四)、审计基金资产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所有限公司
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯卿
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏 洪锐明
联系人:胡小骏

四、基金的名称

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

通过将绝大部分基金资产投资于中小板300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中小板300ETF、中小板300价格指数成份股和备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略

本基金为中小板300ETF联接基金。中小板300ETF是采用完全复制的方法实现对中小板300价格指数紧密跟踪的被动式指数基金,本基金主要通过投资于中小板300ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时、或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理可以对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。

(一)资产配置策略

本基金主要投资于中小板300ETF、中小板300价格指数成份股和备选成份股,其中投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。同时,为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、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,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)目标ETF投资策略

1、投资组合的构建

基金合同生效后,本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,并在建仓期内将股票组合换购成中小板300ETF,使本基金投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%。

2、投资组合的投资方式

本基金投资于中小板300ETF的两种方式如下:

①申购和赎回:中小板300ETF开放申购赎回后,通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。

②二级市场方式:中小板300ETF上市交易后,通过券商在二级市场进行中小板300ETF基金份额的交易。

在基金的日常投资管理中,本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和赎回目标ETF的基金份额,实现指数化投资目标。同时,本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标ETF基金份额。例如,在买入、卖出量低于最小申购、赎回单位时,基金管理人可以通过二级市场直接买入、卖出目标ETF基金份额。这两种投资方式的选择,首先要考虑交易便利性及市场流动性两个方面的因素;其次,在交易制度允许和市场流动性充分的前提下,通过综合考虑交易成本和价格优势,优化得出目标基金ETF份额的买入、卖出数量。

当中小板300ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

3、投资组合的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资中小板300ETF的时间和方式。

①当净申购时,本基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建、中小板300ETF的申购或买入等;

②当净赎回时,本基金将根据净赎回规模及仓位情况,决定中小板300ETF的赎回或卖出等。

(三)股票投资策略

1、股票组合构建原则

根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行中小板指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法,根据中小板300价格指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对股票组合管理进行适当变通和调整,以更紧密的跟踪标的指数。

3、股票组合的调整

①定期调整

本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的中小板300价格指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

②不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动,基金组合跟踪偏离度情况,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

(四)债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,主要投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。

(五)、投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策,特别是对目标ETF份额的投资决策。

3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

①、研究:数量投资部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、目标ETF二级市场的流动性和折溢价分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据。

②、投资决策:投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

③、组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理构建以目标ETF为主的投资组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法、提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

④、交易执行:交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

⑤、绩效评估:金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此总结和检讨投资策略,进而调整投资组合。

⑥、组合监控与调整:基金经理将跟踪目标ETF及标的指数的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中小板300价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

十、风险收益特征

本基金为ETF联接基金,风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于中小板300ETF,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告

广发基金管理有限公司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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行根据本基金基金合同规定,于2011年12月26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9月30日,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(适用于ETF联接基金填写)

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	639,999.00	0.09
	其中:股票	639,999.00	0.09
2	基金投资	658,587,225.05	93.32
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	38,342,148.00	5.43
7	其他各项资产	8,133,423.82	1.15
8	合计	705,702,795.87	100.00

2、期末投资目标基金明细(适用于ETF联接基金填写)

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	广发中小板300ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	广发基金管理有限公司	658,587,225.05	93.67

3、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	548,999.00	0.08
C0	食品、饮料	-	-
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	22,965.00	0.00
C8	医药、生物制品	526,034.00	0.07
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	91,000.00	0.01
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	639,999.00	0.09

4、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	002118	紫鑫药业	25,400	526,034.00	0.07
2	002296	辉煌科技	3,500	91,000.00	0.01
3	002131	利欧股份	1,500	22,965.00	0.00
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5、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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

8、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。

9、投资组合报告附注

①、紫鑫药业10月21日发布公告,称于2011年10月19日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》,因公司涉嫌证券违法违规行为,中国证券监督管理委员会稽查总队决定对公司立案稽查。在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

②、报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

③、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,640,602.40
2	应收证券清算款	126,348.31
3	应收股利	-
4	应收利息	7,768.68
5	应收申购款	358,704.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,133,423.82

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。

⑥、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002118	紫鑫药业	526,034.00	0.07	重大事项停牌
2	002296	辉煌科技	91,000.00	0.01	重大事项停牌
3	002131	利欧股份	22,965.00	0.00	重大事项停牌

十二、基金业绩

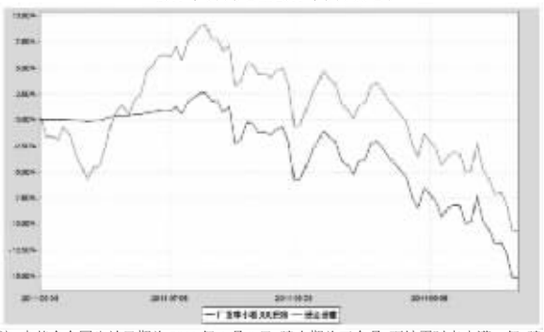
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2011年9月30日。

一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效至今	-15.22%	1.08%	-10.68%	1.32%	-4.54%	-0.24%

二、自基金合同生效以来基金累计份额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

广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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
(2011年6月9日至2011年9月30日)



注:本基金合同生效日期为2011年6月9日,建仓期为三个月,至披露时点未满一年,建仓期结束时本基金资产配置比例符合合同规定。

十三、基金费用与税收

(一)、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、基金合同生效后的信息披露费用;
4、基金份额持有人大会费用;
5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
6、基金的证券交易费用;
7、基金财产拨划支付的银行费用;
8、按照国家有关规定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法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同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,本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额(若为负数,则取0)的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.5%
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值,若为负数,则E取0

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3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,本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额(若为负数,则取0)的0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.1%
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值,若为负数,则E取0

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3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。

3、上述一中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律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。基金募集期间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,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

(五)、费用调整

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。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。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

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》及其它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《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"第三部分 基金管理人"部分,根据基金管理人的人员变动情况进行了更新。
2、在"第四部分 基金托管人"部分,根据托管行人员变动情况和基金托管业务经营情况对托管人信息进行了相应更新。
3、在"第五部分 相关服务机构"部分,增加了相关的代销机构,对原有销售机构的资料进行更新,相关事宜均已公告。
4、在"第九部分 基金的投资"部分,更新了截至2011年9月30日的投资组合报告的内容。
5、在"第十部分 基金的业绩"部分,对截至2011年9月30日的基金业绩表现情况予以披露。
6、根据最新公告对"第二十二部分 其他应披露的事项"进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一二年一月二十日

泰信优质生活股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

(上接C221版)
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
(61)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
电话:0931-8888088
传真:09131-4890515
联系人:李昕田
客户服务电话:0931-96668、4890208
网址:www.hlzqgs.com
(62)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6-8楼
法定代表人:雷建辉
联系人:徐 欣
联系电话:0510-82831662
联系传真:0510-82830162
客服电话:400-888-5288
公司网址:www.glsc.com.cn
(63)恒泰长财证券有限责任公司
注册地址:长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段
办公地址:长春市宽城区珠江路439号
法定代表人:奚星华
联系人:吴德生
联系电话:0431-82951765
联系传真:0431-82946531
客服电话:0431-82951765
公司网址:http://www.cczq.net
(64)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
办公地址: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:吴志明
联系人:吴志明
电话:020-87322668
传真:020-87325036
客服电话:020-961303
网址:www.gzs.com.cn
(65)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址: 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49楼
法定代表人:高竹
客服电话:40018-40028
网址:www.wkzq.com.cn
(二)注册登记机构
名称: 泰信基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号37层
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号 华夏银行大厦36、37层
法定代表人:孟凡利
总经理:高清海
成立日期:2003年5月23日
电话:(021)20899188
传真:(021)20899008
联系人:韩波
网址:www.ftfund.com
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、田卫红
联系人:田卫红
(四)审计基金财产的会计师事务所
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:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心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
经办注册会计师:薛竞、张振波

五、基金的名称

基金名称:泰信优质生活股票型证券投资基金
基金简称:泰信优质生活股票

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

分享中国经济可持续发展过程中那些最能够满足人们优质生活需求的上市公司的长期稳定增长,在严格控制投资风险的基础上,谋求基金资产的长期稳定增值。

八、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,包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金组合投资的范围为:股票资产60%-95%,,债券资产0%-35%,基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在征得有关监管机构许可后,可以将其纳入投资范围,不需召开基金份额持有人大会。

九、基金的投资策略

本基金看好直接提供优质生活产品和服务的大消费类生产、服务行业的长期发展前景,长期持有消费类行业中的持续成长型公司,同时注重挖掘间接提供优质生活产品和服务的优质公司的投资机会。本基金的股票资产主要投资于能够直接提供优质生活产品和服务的持续成长型的大消费类生产和服务类公司,同时在间接提供优质生活产品和服务的非消费类行业中选择价值低估、经营稳健、稳定增长的优质公司。

本基金采取"自上而下"的大类资产配置、以核心-卫星策略为基础的优质生活行业配置和"自下而上"的证券精选相结合的投资策略。

(一)决策依据

1、国家有关法律法规和基金合同的规定;
2、政治形势、政策趋势和宏观经济形势;
3、证券市场发展趋势。

(二)决策程序

本基金参与投资决策和操作的机构和部门包括:投资决策委员会、基金投资部、研究部。具体程序如下:

①金融工程人员选择合适的金融工具,对市场各类收益率曲线进行拟合,并对各类收益率曲线之间的相对关系以及收益率曲线和宏观经济之间的关系进行数量分析;

②研究部与基金投资部联合对宏观经济和债券市场深入研究,初步确定资产配置方案;

③基金经理构造投资组合计划;

④金融工程人员对投资组合计划进行风险收益分析,提出修正意见;研究部策略分析师通过宏观经济以及债券市场分析,对投资组合的资产配置提出调整意见;

⑤投资决策委员会最后确定投资组合方案;

⑥基金经理通过交易过程完成投资组合方案的构建;

⑦金融工程人员对投资组合进行跟踪评估,提出风险控制意见,按照风险大小,定期或随时向基金经理、投资总监、投资决策委员会报告;

⑧风险管理部、监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行监控;

⑨评估和调整决策程序:投资决策委员会根据市场环境的变化和实际需要可以调整决策的程序,基金经理调整投资组合应按授权权限和批准程序进行;

⑩在确保基金份额持有人合法权益的前提下,基金管理人有权根据市场变化和实际需要对上述程序做适当的调整。

(三)投资组合管理的方法和标准

1、投资组合限制

使用积极管理的投资策略获取超出业绩比较基准的回报的前提是充分保障基金资产的稳妥和流动性,本基金通过科学的分析方法和数量化分析工具来降低非系统性风险。本基金投资组合将遵循以下限制:

①现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%;

②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%;

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;

⑤运用基金财产进行权证投资时,不得有下列情形:

本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的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的同一权证不得超过该权证的10%;

⑥本基金若投资非公开发行证券,应严格遵守证监会关于投资非公开发行证券的有关规定;

⑦法律法规和基金合同规定的其他限制。

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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

2、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,在履行适当程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为:75%*富时中国A600指数 + 25%*富时中国国债指数

十一、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的中高风险品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。适合于能够承担一定股市风险,追求资本长期增值的个人和机构投资者。

十二、基金的投资组合报告 (未经审计)

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已于2011年12月27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。

1、截至2011年9月30日基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,615,508,526.98	94.41
	其中:股票	1,615,508,526.98	94.41
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	92,252,806.84	5.39
6	其他资产	3,465,703.07	0.20
7	合计	1,711,227,036.89	100.00

2、截至2011年9月30日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	19,152,896.50	1.13
B	采掘业	43,137,060.00	2.54
C	制造业	1,251,869,559.68	73.61
C0	食品、饮料	62,058,280.13	3.65
C1	纺织、服装、皮毛	14,226,100.00	0.84
C2	木材、家具	760,200.00	0.04
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	52,388,174.76	3.08
C5	电子	200,977,114.65	11.82
C6	金属、非金属	87,526,600.00	5.15
C7	机械、设备、仪表	374,649,256.77	22.03
C8	医药、生物制品	457,901,433.37	26.92
C99	其他制造业	1,382,400.00	0.08
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,625,462.72	0.15
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	82,872,548.08	4.87
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	215,546,400.00	12.67
L	传播与文化产业	304,600.00	0.02
M	综合类	-	-
	合计	1,615,508,526.98	94.99

3、截至2011年9月30日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	601888	中国国旅	3,820,000	94,010,200.00	5.53
2	000823	超声电子	6,619,605	92,939,254.20	5.46
3	000423	东阿阿胶	2,133,688	88,526,715.12	5.21
4	000012	南 玻A	6,190,000	87,526,600.00	5.15
5	000538	云南白药	1,529,970	86,443,305.00	5.08
6	002073	软控股份	4,720,600	85,820,508.00	5.05
7	600993	马应龙	4,904,973	84,610,784.25	4.97
8	300070	碧水源	2,137,000	79,496,400.00	4.67
9	000541	佛山照明	6,450,000	72,885,000.00	4.29
10	600750	江中药业	2,920,000	67,598,000.00	3.97

4、截至2011年9月30日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。

5、截至2011年9月30日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。

6、截至2011年9月30日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、截至2011年9月30日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、截至2011年9月30日本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

②、截至2011年9月30日本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定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	3,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,986.83
5	应收申购款	445,716.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,465,703.07

④、截至2011年9月30日本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

⑤、截至2011年9月30日本基金前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

⑥、报告期末本基金未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

十三、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)本基金合同生效日为2006年12月15日。基金合同生效以来(截至2011年9月30日)的投资业绩与同期基准的比较如下表所示:

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
2011-01-01至2011-09-30	-26.21%	1.41%	-14.68%	0.96%	-11.53%	0.45%
2011-01-01至2011-06-30	-15.77%	1.46%	-3.08%	0.93%	-12.69%	0.53%
2010-01-01至2010-12-31	0.54%	1.89%	-5.17%	1.17%	5.71%	0.72%
2009-01-01至2009-12-31	65.11%	2.07%	66.03%	1.53%	-0.92%	0.54%
2008-01-01至2008-12-31	-55.01%	2.22%	-52.90%	2.28%	-2.11%	-0.06%
2007-01-01至2007-12-31	111.00%	2.30%	102.36%	1.72%	8.64%	0.58%
2006-12-15至2011-09-30	25.93%	2.03%