

(上接A37版)

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
 法定代表人:刘弘
 电话:010 59226788
 传真:010 59226799
 客户服务电话:400-887-8827
 网址:www.assecurities.com.cn
 80 中国中投证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田益田路与福中路交界处荣超商务中心A座第18层-21层
 办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A座18-21层
 法定代表人:龙增来
 电话:0755 82023442
 传真:0755 82026359
 客户服务电话:4006-008-008
 网址:www.citics.com
 81 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
 办公地址: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.zsq.com.cn
 82 招商证券股份有限公司
 注册地址:广东省深圳市福田区益田路55号15层1501号
 办公地址:广东省深圳市福田区益田路55号15层1501号
 法定代表人:李卫刚
 电话:0755 82943755
 传真:0755 82940511
 客户服务电话:0755 82943755
 网址:www.zq.com.cn
 83 中信证券股份有限公司
 注册地址:深圳市福田区福林南路18号
 办公地址:深圳市福田区福林南路18号
 法定代表人:孔旭东
 电话:0471 6292587
 传真:0471 6292477
 客户服务电话:0471 6292477
 网址:www.citics.com.cn
 84 江海证券有限公司
 注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区露水路56号
 办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区露水路56号
 法定代表人:孙洪涛
 电话:0451 82286663
 传真:0451 82282711
 客户服务电话:4006-62288
 网址:www.jhzq.com.cn
 85 诺安基金销售有限公司
 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
 电话:028 86690125
 传真:028 86690129
 客户服务电话:4006-600109
 网址:www.nuanfund.com
 86 华安基金管理有限公司
 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.cnhsf.com.cn
 87 厦门证券有限公司
 注册地址:厦门市湖滨西路2号鹭富大厦十七楼
 办公地址:厦门市湖滨西路2号鹭富大厦十七楼
 法定代表人:傅耀群
 电话:0592 5161642
 传真:0592 5161140
 客户服务电话:0592 5163588
 网址:www.xmzq.com.cn
 88 凌波证券有限责任公司
 注册地址:上海市世纪大道1600号32楼
 办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
 法定代表人:蒋林
 电话:021 33229888
 传真:021 62878701
 客户服务电话:021 63340678
 网址:www.lbjz.com.cn
 89 光大证券股份有限公司
 注册地址:深圳福田区深南中路华能大厦三十层、三十一层
 办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦十一、三十一、三十二层
 法定代表人:刘关
 电话:0755 83004101 83007166
 传真:0755 83000734
 客户服务电话:0755-26982993
 网址:www.yds.com.cn
 90 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 58568002
 传真:010 58568062
 客户服务电话:01058568162
 网址:www.hrsec.com.cn
 91 沃风投资有限责任公司
 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:武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座10楼
 法定代表人:余磊
 电话:027 87618889
 传真:027 87618863
 客户服务电话:028-86712334
 网址:www.wofeng.com.cn
 92 财信证券有限责任公司
 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:马功勤
 电话:024 12326697
 传真:024 12326617
 客户服务电话:4006180315
 网址:www.stockren.com
 93 大通证券股份有限公司
 注册地址:大连市河口区会展路129号大连国际金融中心A座--大连通大
 办公地址:大连市河口区会展路129号大连通大期货大厦39层
 法定代表人:董承代
 电话:0411 39673301
 传真:0411 39673219
 客户服务电话:4008-169-169
 网址:www.estock.com.cn
 94 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 66045058
 传真:010 66045050
 客户服务电话:010 66045078
 网址:www.txsc.com.cn
 95 瀚时中证券有限责任公司
 注册地址:北京市西城区北三环西路99号院1号楼15层1501
 办公地址:北京市西城区北三环西路99号院1号楼15层1501
 法定代表人:吴斌
 电话:010 83561149
 传真:010 83561199
 客户服务电话:400-698-9897
 网址:www.hsxzjz.com.cn
 96 浙商证券股份有限公司
 注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座7楼
 办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座7楼
 法定代表人:吴承祖
 电话:0571 87901053
 传真:0571 87901913
 客户服务电话:0571 87907777
 网址:www.stocke.com.cn
 97 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号庄家金融大厦24层
 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:董建强
 电话:0311 86028442
 传真:0311 86060244
 客户服务电话:4006128888
 网址:www.caida.com.cn
 98 民生证券股份有限公司
 注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
 办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
 法定代表人:余政
 电话:010 85120190
 传真:010 85120191
 客户服务电话:4006198888
 网址:www.msizq.com.cn
 99 财富证券有限责任公司
 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:021-38748418
 传真:021-68755787
 客户服务电话:021-38784818
 网址:www.cfsc.com.cn
 100 融通证券股份有限公司
 注册地址:杭州大道15号华恒国际商务中心
 办公地址:杭州大道15号华恒国际商务中心
 法定代表人:沈强
 客服电话:0571-96336
 网址:www.rtfund.com
 101 上海好易基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区场中路685号37号4楼449室
 办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室
 法定代表人:杨文斌
 电话:400-700-9665
 传真:021-68599161
 客户服务电话:021-68599161
 网址:www.htfunds.com
 102 上海天基金销售有限公司
 注册地址:浦东新区峨山路613号6幢515室
 办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
 法定代表人:其实
 电话:400-181-8188
 网址:www.1234567.com.cn
 103 上海长盛基金销售有限公司
 注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室
 办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟
 电话:021-58788678
 网址:www.e-rich.com.cn
 104 杭州数米基金销售有限公司
 注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路2号
 办公地址:浙江省杭州市余杭区江干大道3588号12楼
 法定代表人:陈柏青
 电话:4006-766-123
 网址:www.fund123.com
 105 嘉实中证700 基金销售投资顾问有限公司
 注册地址:上海虹口区四川路360弄9号3724室
 办公地址:上海市杨浦区蕴川路360弄9号3724室 2楼
 法定代表人:汪静波
 电话:400-821-5399
 传真:021-38509777
 网址:www.noah-fund.com
 106 万银财富(北京)基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区东四环中路27号院5号楼3201单元
 办公地址:北京市朝阳区东四环中路27号院5号楼3201单元
 法定代表人:李昭强
 客服电话:4008800809
 网址:www.wy-fund.com
 107 北京展恒基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区后厂峪路财富中心2楼
 办公地址:北京市朝阳区德福门内华严里北里2号楼6层
 法定代表人:闫俊杰
 客服电话:400-888-6661
 网址:www.zhifund.com
 108 中期资产管理有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号11层
 办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号11层2层
 法定代表人:路路
 客服电话:95162-400888160
 网址:www.cifofund.com
 109 浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:杭州市文二西路一号元茂大厦903室
 办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
 法定代表人:凌顺平
 客服电话:0571-89020897 4008-773-772
 公司网址:www.5ifund.com
 110 深圳众基金销售有限公司
 注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
 办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
 法定代表人:卢峰
 客服电话:4006-788-887
 网址:www.zlfund.com www.jimwm.com
 111 联讯证券股份有限公司
 注册地址:广东省惠州市江北路3路55号广播电视新闻中心三、四、五层
 办公地址:广东省惠州市江北路3路55号广播电视新闻中心三、四、五层
 法定代表人:徐刚
 客服电话:95564
 网址:www.lxsec.com.cn
 (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:上海浦东新区世纪大道8号,上海国金中心二期31、32层
 法定代表人:李办
 电话:021 59699999
 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:韩朝
 电话:021 31358666
 传真:021 31358600
 经办律师:秦虹、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200号普华永道中心11楼
 法定代表人:杨劲松
 联系电话:021 23238888
 联系人:沈兆杰
 经办会计师:江建、庄贤良

基金风险评估采用风险管理部部门开发模型,评估组合风险价值,行业配置、估值、流动性、利率和信用等风险,绩效评价采用华安自主研发组合绩效分析系统和第三方数据因子系统,对投资组合指定时间段进行绩效分解,归因收益和风险来源。
 风险管理部定期和不定期对基金进行风险和绩效评价,并提供相关报告。风险评估是否得投资决策委员会和基金经理能够及时了解组合是否承担了超出合同约定的投资策略,绩效评价能够确认组合是否实现了投资策略,组合收益的来源及投资策略成功与否,基金经理可以及时发现投资风险,进而调整投资组合。
 6. 合规监督与调整
 (一) 合规监督
 合规监督稽核部对基金投资组合进行合规监控,合规监督稽核部依据证券基金相关投资规定,同时结合本公司实际情况,进行投资组合的合规监控。
 基金经理将跟踪经济状况、证券市场 and 上市公司的发展变化,结合基金申购和赎回的现金流量情况,以及组合风险与绩效评价的结果,对投资组合进行监控和调整,使之不断得到优化。
 (二) 投资组合调整
 1. 组合调整
 本基金投资策略原则上按照投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金资产的系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
 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百分之十;
 ② 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的百分之二;
 ③ 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的百分之十;
 ④ 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的百分之十;
 ⑤ 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百分之四;
 ⑥ 本基金基金资产投资比例范围为基金资产净值的60%-95%,债券的投资比例为基金资产净值的5%-40%,现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%以上;
 ⑦ 本基金参与股指期货交易,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;
 ⑧ 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千分之十;
 ⑨ 法律法规或中国证监会规定的其它比例限制。
 ⑩ 如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,则本基金不受上述限制。
 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以外的因素致使基金投资比例不符合上述 ①-⑩ 项规定的投资比例,基金管理人应当在10个工作日内进行调整。
 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。
 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。
 (三) 基金的投资
 本基金可以按照国家的相关规定进行融资。
 基金整体业绩比较基准=中信标普300指数收益率*90%+同业存款利率*x10%
 其中: 中信标普300 指数是中国证券股份有限公司和标准普尔 Standard & Poor's 共同开发的中国 A 股市场指数,由沪深两市具有行业代表性的上市公司组成,其样本股票经过了流动性与财务稳健性的审慎检查,能较全面地描述 A 股市场总体趋势;同业存款利率是中国人民银行规定的金融机构间存款利率。
 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,本基金管理人可依循维护基金份额持有人的合法权益的原则,对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更须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。
 十二、基金的风险收益特征
 本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益要高于传统型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金资产的稳定增值。
 十三、基金的投资组合报告
 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。
 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年9月16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,保证复核数字不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2013年6月30日。
 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	5,053,190,631.66	87.71
2	固定收益投资	337,870,000.00	5.86
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收股利	65,028,009.29	1.14
6	其他金融资产	304,035,988.88	5.28
7	合计	5,761,025,525.83	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,094,611.34	0.21
B	采矿业	217,359,939.64	3.81
C	制造业	3,194,703,109.02	55.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	214,745,522.24	3.74
E	建筑业	278,451,375.63	4.83
F	批发和零售业	53,968,200.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	23,840,000.00	0.42
H	信息传输、软件和信息技术服务业	82,278,850.39	1.44
I	金融业	1,852,800.00	0.03
J	房地产业	608,794,000.00	10.60
L	租赁和商务服务业	1,167,600	0.00
M	科学研究和技术服务业	105,800.00	0.00
N	卫生、环境和公共设施管理业	365,994,303.75	6.41
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		5,053,190,631.66	88.47

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	400,000	39,612,000.00	0.69

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	1101079	10债79	1,300,000	129,584,000.00	2.27
2	1101070	10债70	500,000	49,485,000.00	0.87
3	1101065	10债65	500,000	49,910,000.00	0.88
4	1101069	10债69	500,000	49,885,000.00	0.87
5	080026	08国债26	4		