# 华富量子生命力股票型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

（2012年第2号）

**基金管理人：华富基金管理有限公司**
**基金托管人：平安银行股份有限公司**

**重要提示：**

本基金经中国证券监督管理委员会2010年11月9日证监许可［2010］1585号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

华富基金郑重提醒您在做出投资决策前应认真阅读本风险提示函和本基金的《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

本基金不同于具有稳定收益和低风险的银行存款和国债，本基金的基金资产中股票投资比例的变动范围为60%-95%，属于基金产品中具有较高风险和较高预期收益的股票型基金，适合有稳定收入来源、风险承受能力相对较强、并希望分享中国证券市场长期发展成果的投资者。中国资本市场未来发展前景广阔，但股市投资始终伴随风险，股价波动更是无法避免，本基金至少60%的资产投资于股票市场，基金份额净值必然会随股市行情变化上下波动，持有人购买的基金份额净值因此存在下跌甚至亏损的可能性。对希望通过短期资金、借贷资金以及养老资金进行投机快速获得高额收益的投资者可能面临较大的风险。

华富基金承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩和华富基金的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。华富基金提醒投资人基金投资的"买者自负"原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2012年10月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年9月30日。

（一）基金合同生效

本基金于2011年4月1日正式生效。

（二）基金管理人

1、基金管理人概况

名称：华富基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
邮政编码：200120
法定代表人：章宏韬
设立日期：2004年4月19日
核准设立机关：中国证监会
核准设立文号：中国证监会证监基金字［2004］47号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1.2亿元人民币
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
联系人：尤艳
电话：021-68886996
传真：021-68887997

股权结构：华安证券有限责任公司49%、安徽省信用担保集团有限公司27%、合肥兴泰控股集团有限公司24%

2、主要人员情况

（1）基金管理人董事会成员

章宏韬先生，董事长，本科学历，工商管理硕士学位。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员，安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科秘书，安徽证券交易中心综合部（办公室）经理助理、副经理（副主任），安徽省证券公司合肥蒙城路营业部总经理，华安证券有限责任公司总裁办副主任、总裁助理兼办公室主任，现任华安证券有限责任公司党委委员、副总裁，华安期货有限责任公司董事。

李工先生，董事，本科学历，香港浸会大学工商管理硕士学位。历任合肥市财政局副科长、科长、副局长，合肥市信托投资公司总经理兼党支部书记，合肥市政府副秘书长、合肥市财政局党组书记，合肥市商业银行董事长、党组书记、行长，合肥市政府副秘书长、党组副书记，合肥市政府办公厅主任，中共肥西县委书记、肥西县人大常委会主任，安徽省农村信用联合社副理事长、副主任。现任华安证券有限责任公司党委书记、董事长，华安期货有限责任公司董事。

杨新潮先生，董事，大专学历，高级经济师。历任安徽省经贸委综合处、财金处调研员，安徽省经贸投资集团总经理，安徽省中小企业担保公司董事长、总经理。现任安徽省信用担保集团副总经理，安徽省科技产业投资公司董事长。

刘庆年先生，董事，大学本科学历。历任解放军某部排长、指导员，副营职干事，合肥市财政局任党组秘书、合肥市财政局副局长（住持工作）、合肥市财政证券公司总经理（法人代表），国元证券寿春路第二营业部总经理，华富基金管理有限公司督察长。

刘瑞中先生，独立董事，研究生学历。历任安徽铜陵财专教师，中国经济体制改革研究所助理研究员、信息部主任；中国国际期货经纪有限公司任信息部经理、深圳公司副总经理，北京商品交易所常务副总裁，深圳特区证券公司（现已北京华创投资管理有限公司）总裁，深圳神华期货经纪有限公司独立董事。

陈庆平先生，独立董事，工商管理硕士。历任上海金融专科学校讲师、处长，中银证券公司哈尔滨营业部总经理，上海鑫兆投资管理咨询有限公司顾问，上海金融学院客座教授。现任宁波国际银行上海分行行长。

汪明华先生，独立董事，法律研究生学历。历任安徽省高级人民法院审判员、处长、主任，合肥市中级人民法院副院长，省高级法院经济庭、民二庭庭长等职。现任安徽承义应用法学研究所所长。

（2）基金管理人监事会成员

王思道先生，监事会主席，本科学历。历任上海财经大学金融理论教研室助教，安徽省财政厅副主任科员，安徽省托投资公司部门经理、安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省皖煤投资有限公司总经理。现任安徽省信用担保集团有限责任公司总经济师。

梅鹏军先生，监事，金融学博士。先后供职于安徽省国际经济技术合作公司，安徽省物资局（后更名为"安徽省商集团有限公司"），合肥兴泰控股集团有限公司。现任合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所所长。

陈大毅先生，监事，研究生学历。先后供职于安徽省证券公司上海自忠路营业部、徐家汇路营业部，华安证券上海总部，华安证券网络经纪公司（筹）。现任华富基金管理有限公司总经理助理兼运作保障部总监。

（3）基金高级管理人员及督察长

姚怀然先生，公司总经理，学士学位、研究生学历。历任人民银行安徽省分行金融管理处主任科员，安徽省证券公司营业部经理、总办主任、总经理助理兼证券投资总部总经理，华安证券有限责任公司总裁助理兼证券投资总部总经理，华富基金管理有限公司董事长。

满志宏女士，公司督察长，管理学硕士，CPA，曾任道勤控股股份有限公司财务部总经理，华富基金管理有限公司监察稽核部副总监兼董事会秘书。

（4）本基金基金经理简介

朱蓓女士，上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历，五年证券投资研究、保险公司资产管理从业经历，曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理，华富基金金融工程研究员、产品设计经理。

（5）投资决策委员会成员

投资决策委员会是负责基金投资决策的最高权力机构，由公司分管投资业务的领导、涉及投资和研究的部门的业务负责人以及投资决策委员会认可的其他人员组成。投资决策委员会主席由公司分管投资业务的最高业务领导担任，负责投决会的召集和主持。

投资决策委员会成员姓名和职务如下：

| | |
|---|---|
| 姚怀然先生 | 总经理 |
| 陈茹女士 | 研究部总监 |
| 汪开振先生 | 非公募资产管理部总监 |
| 胡伟先生 | 固定收益部副总监 |

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金托管人

1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司（以下简称"平安银行"）
成立日期：1987年12月22日
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号
注册资本：512335.04万元
法定代表人：肖遂宁
资产托管业务批准文号：中国证监会证监许可［2008］1037号
联系人：宋菁
联系电话：0755）8208 8761

2、发展概况

平安银行股份有限公司（简称：平安银行，股票代码：000001）是中华人民共和国第一家面向社会公众公开发行股票并上市的商业银行。

2012年6月15日，根据《中国银监会关于深圳发展银行吸收合并平安银行的批复》（银监复［2012］192号），深发展已完成吸收合并平安银行的所有法律手续，深发展和平安银行（"原两行"）已经正式合并为一家银行。

2012年8月2日，原深发展银行更名为平安银行股份有限公司，简称平安银行。

2012年9月25日，平安银行股份有限公司对外公告，肖遂宁先生、理查德先生分别辞去公司董事长、行长职务，拟选举孙建一先生为公司董事长，并聘任邵平先生为公司行长。以上任职需经银行业监督管理委员会核准。

2012年1-9月份，平安银行总资产达14775.31亿元，总贷款达7050.84亿元，总存款达9353.97亿元，净利润103.46亿元，不良贷款率为0.80%，拨备覆盖率209.40%；资本充足率和核心资本充足率分别为11.30%和8.47%，符合监管要求。

平安银行总行设资产托管部，下设企划分析、运营管理、营销管理和投资监督4个团队，现有员工29人。

平安银行于2008年1月4日经深圳市银监局核准，获得运营信托保管业务资格；2008年8月6日经中国证监会和中国银监会核准，获得证券投资基金托管资格；2010年1月2日经中国银监会核准，获得全国社会保障基金托管资格；平安银行已具备七大类20多种资产托管服务，与多家基金公司、证券公司、信托公司、商业银行等展开了紧密的合作。

3、主要人员情况

叶萍，女，大学学历，高级会计师，长期从事银行会计工作，精通本外币资金清算，具有多年计财、零售业务管理经验。1982年11月至1989年3月在中国银行惠州分行工作；1989年4月至1990年5月在深圳发展银行上步支行工作；1990年6月至1999年6月在深圳发展银行总行国际业务部工作，历任外汇会计室副经理、经理；1999年6月至2002年2月任深圳发展银行清算中心副主任（副总经理级）；2002年3月至2007年6月任深圳发展银行深圳分行副行长；2007年7月至2008年1月任深圳发展银行总行零售运营管理部副总经理兼集金托管筹备小组副组长；2008年1月-8月拟任深圳发展银行资产托管部副总经理；2008年8月起任深圳发展银行资产托管部副总经理，2012年8月23日任平安银行总行资产托管部总经理。

4、基金托管业务经营情况

2008年8月6日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

（四）相关服务机构

1、基金份额发售机构

（1）直销机构：

名称：华富基金管理有限公司
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
法定代表人：章宏韬
联系人：李晔
咨询电话：400-700-8001；021-50619688
传真：021-68415680
网址：www.hffund.com

（2）代销机构：

①平安银行股份有限公司
法定代表人：肖遂宁
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人：肖遂宁
联系人：周晓霞
联系电话：0755-22166212
传真电话：0755-82080714
客户服务电话：95511
公司网址：www.bank.pingan.com

②中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25 号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1 号院1 号楼
法定代表人：王洪章
客服电话：95533
传真：010-66275654
网址：www.ccb.com

③中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：杨菲
联系电话：010-66107909
客服电话：95588
公司网站：www.icbc.com.cn

④招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088 号招商银行大厦
办公地址：深圳市福田区深南大道7088 号
法定代表人：傅育宁
电话：0755-83198888
传真：0755-83195049
联系人：邓炯鹏
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

⑤交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188 号
法定代表人：胡怀邦
电话：021-58781234
传真：021-58408483
联系人：陈铭铭
客服电话：95559
网址www.bankcomm.com

⑥上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区浦东南路500 号
办公地址：上海市中山东一路12 号
法定代表人：吉晓辉
联系电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：倪苏云、虞谷云
客服电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

⑦中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
电话：010-57092615
传真：010-57092611
联系人：董云巍
客服电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

⑧北京银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：谢小华
电话：010-66223587
传真：010-66226045
客户服务电话：95526
公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

⑨渤海银行股份有限公司
住所：天津市河西区马场道201-205号
法定代表人：刘宝凤
电话：022）58316666
传真：022）58316259
联系人：王宏
客服电话：400-888-8811
网址：www.cbhb.com.cn

⑩华夏银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街22 号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
电话：010）85238425
传真：010）85238680
联系人：马旭
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

⑪华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
联系电话：0551-5161821
传真：0551-5161672
客服电话：0551-96518、400-809-6518
公司网址：www.huaans.com.cn

⑫爱建证券有限责任公司
住所：上海市南京西路758 号24楼
法定代表人：郭林
联系人：陈敏
电话：021-32229888
客服电话：021-63340678
网址：www.ajzq.com

⑬信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
电话：010-63081000
传真：010-63080978
客服电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

⑭国都证券有限责任公司
住所：北京市东城区东直门南大街3 号国华投资大厦9 层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183333
客服电话：400-818-8118
网址：http://www.guodu.com

⑮天风证券有限责任公司
住所：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
联系人：翟璐
电话：027-87618882
传真：027-87618863
客服电话：027-87618882、028-86711410
网址：www.tfzq.com

⑯齐鲁证券有限责任公司
住所：山东省济南市经十路128 号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-82093669
传真：0531-81283900
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

⑰民生证券有限责任公司
住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A 座16-20层
法定代表人：岳献春
联系人：赵明
电话：010-85127622
客服电话：4006198888
公司网址：www.mszq.com

⑱长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务热线：95579或4008-888-999
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务网站：www.95579.com

⑲海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98 号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
传真：021-53858549
客服电话：95553、400-888-8001
网址：http:// www.htsec.com

⑳光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508 号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客服电话：1010899、400-888-8788
网址：www.ebscn.com

㉑中国中投证券有限责任公司
住所：深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第18 层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
客服电话：400-600-8008
网址：www.cjis.cn

㉒万联证券有限责任公司
住所：广州市天河区珠江东路高德置地广场F栋18、19层
法定代表人：张建军
联系人：罗创斌
电话：020-37865070
传真：020-37865008
客服电话：400-888-8133
网址：www.wlzq.com.cn

㉓兴业证券股份有限公司
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
电话：021-38565785
客服电话：95562
公司网站：www.xyzq.com.cn

㉔山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69 号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭熠
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

㉕日信证券有限责任公司????
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西座11层
法定代表人：孔佑杰
联系人：陈韦杉
电话：010-88086830
公司网站：www.rxzq.com.cn

㉖江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：孙宏宇
电话：0451-82336863
传真：0451-8228721l
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

㉗长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008 号特区报业大厦14/16/17 层
法定代表人：黄耀华
联系人：李春芳
电话：0755-83516222
传真：0755-83516189
客服电话：400-666-6888、0755-33680000
网址：www.cgws.com.cn

㉘大通证券股份有限公司
住所：大连市中山区人民路24号
法定代表人：董水成
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
客服电话：4008-169-169
网址：www.daton.com.cn

㉙国泰君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168 号上海银行大厦29 楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
电话：021-38676666
传真：021-38670666
客服电话：4008-888-666
网址：http://www.gtja.com.cn

㉚国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客服电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

㉛世纪证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道7088 号招商银行大厦41/42层
法定代表人：卢长才
联系人：方文
电话：0755-83199599
传真：0755-83199545
网址：www.csco.com.cn

㉜厦门证券有限公司
住所：厦门市莲前西路2 号莲富大厦17楼
法定代表人：傅毅辉
联系人：卢金文
电话：0592-5161642
传真：0592-5161140
客服电话：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn

㉝中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66 号4号楼
法定代表人：王常青
联系人：权朋
电话：010-65183888
传真：010-65182261
客服电话：400-888-8108
公司网址：www.csc108.com

㉞东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18、19楼
法定代表人：朱利敏
联系人：程学军
电话：021-50586660
传真：021-50586660-8881
客服电话：021-52574550
公司网站： www.longone.com.cn

㉟国联证券股份有限公司
住所：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：徐欣
客服电话：95570
网址：www.glsc.com.cn

㊱新时代证券有限责任公司
住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
电话：010-83561149
传真：010-83561049
联系人：孙恺
客户服务电话：400-698-9898
网址：www.xsdzq.cn

㊲中国银河证券股份有限公司
住所：北京市东城区东直门南大街35 号国际企业大厦C座
法定代表人： 顾伟国
联系人：田薇
电话：010-66568430
传真：010-66568116
客服电话：400-888-8888
网址： www.chinastock.com.cn

㊳华龙证券有限责任公司
住所：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦
办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
电话：0931-8784656
客服电话：96668
网址：www.hlzqgs.com

㊴南京证券有限责任公司
住所：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
电话： 025-83364032
传真：025-83320066
客户服务电话：400-828-5888
网址：www.njzq.com.cn

㊵华福证券有限责任公司
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7-10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
客服电话：0591-96326
公司网站：www.gfhfzq.com.cn

㊶东北证券股份有限公司
住所：吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锴
电话：0431-85096709
客服电话：400-600-0686、0431-85096733
网址：www.nesc.cn

㊷中山证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区益田路6099号新世界中心29层
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心29层
法定代表人：吴永良
联系人：李珍
电话：0755-82570586
客服电话：400-102-2011
公司网站：http://www.zszq.com

㊸安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82825551
客服电话：4008001001
公司网站： www.essence.com.cn

㊹招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
联系电话：0755-82943666
客服电话：95565、4008888111
公司网站：www.newone.com.cn

㊺中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区香港东路316号
办公地址：青岛市东海西路28号
法定代表人：史浩民
电话：0532-85022326
传真：0532-85022511
联系人：丁韶燕
客服电话：0532-96577
公司网址：www.zxwt.com.cn

㊻申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
电话：021-54033888
传真：021-54038844
联系人：李清怡
客服电话：95523或4008895523
电话委托：021-962505
网址：www.sywg.com

㊼华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：万鸣
联系电话：025-83290979
客服电话：95597
公司网站：www.htsc.com.cn

㊽中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人：王东明
联系人：陈思
电话：010-60833799
公司网站：www.cs.ecitic.com

㊾平安证券有限责任公司
住所：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：0755-22626391
传真：0755-82433794
客户服务电话： 95511-8
公司网址：www.pingan.com

㊿华宝证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：赵洁
电话：021-50122131
客服电话：400-820-9898、021-38929908
网址：www.cnhbstock.com

(51)东吴证券股份有限公司
住所：苏州工业园区翠园路181号
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
电话：0512-65581136
传真：0512-65588021
客服电话：0512-33396288
公司网址：www.dwzq.com.cn

(52)国海证券有限责任公司
住所：广西桂林市辅星路13号
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人：张雅锋
联系人：牛孟宇
电话：0755-83709350
传真：0755-83700205
客服电话：95563

(53)杭州数米基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道海曙东路2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周臻旻
电话：0571-28829790、021-60897869
传真：0571-26698533
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

2、注册登记机构

名称：华富基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层
法定代表人：章宏韬
联系人：陈大毅
电话：021-68886996
传真：021-68887997

3、出具法律意见书的律师事务所

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
联系人： 黎明
经办律师：吕红、黎明

4、审计基金财产的会计师事务所

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）
主要经营场所：杭州市西溪路129号9楼??
执行事务合伙人：胡少先
电话：021-62281910
传真： 021-62286290
联系人：曹小勤
经办注册会计师：曹小勤、李勤

（五）基金名称

华富量子生命力股票型证券投资基金

（六）基金的运作方式

契约型、开放式

（七）基金的投资目标

本基金主要采用数量化投资方法，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

（八）基金的投资范围

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、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%；债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

（九）基金的投资策略

1.资产配置策略

本基金在进行资产配置时，主要根据基金管理人开发的"估值驱动战略资产配置模型"，通过对市场未来1-3个月整体估值水平进行预测，实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。模型从市场估值的驱动因素出发，通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合，构建市场趋势预测模型。该因子库包括的驱动因子包括但不限于：经济面因子、供求面因子、政策面因子、估值面因子、情绪面因子、盈利面因子。模型结果最终汇总为一个综合的配置指标，通过对市场未来走势的预测结果，调整基金在各类资产之间的配置比例。

2.股票投资策略

在股票投资策略方面，本基金主要投资于综合资质优良、价值相对低估，能为股东创造持续稳健回报的公司。在A股市场中，采用自下而上的选股策略，实行组合个股精选以及行业权重优化的全程数量化投资模式。

本基金严格遵循"价值投资"理念，围绕价值和价格两大因素，通过公司资质和估值情绪双层筛选机制，逐级筛选股票，并最终确定股票投资组合。

公司资质定量识别：

资质优良是构建本基金投资组合的必要条件。优质的上市公司，既可以分享中国经济的快速成长，也可以在经济周期下行时具备更强的抵御能力，是攻守兼备的投资前提。

本基金主要基于对上市公司财务数据的分析，定量识别能够评价上市公司资质的各类因子。这些因子包括但不限于：产品竞争力类（应收账款、应付账款、毛利率等），资产收入质量类（资产现金率、销售现金收入等），盈利能力类（资产报酬率、资本回报率、权益税前报酬率等），以及管理能力类（资产周转率、存货周转率、三费周转率等）。

在实证检验的基础上，本基金根据不同行业所属的周期性质、盈利模式、产业结构等特性，选取相应的行业优化资质评价因子，在行业内进行打分排序，挑选出各类因子综合排序前三分之一的股票，构成优质公司初选池。

本基金将根据上市公司年度财务数据，按照该模型和流程，定期对上市公司进行筛选和排序，从而调整和优化股票组合。

估值情绪定量识别：

在对上市公司进行资质筛选的基础上，对股票估值和投资者情绪进行研究，有助于本基金更好地把握投资时点，在股票价格高估时及时规避风险，在股票价格低估时及时捕捉投资机会。

从优质公司初选池中，按估值因子和情绪因子对个股进行打分排序，在考虑了行业分布等调整因素后，选取综合排名靠前的一组股票构建最终的股票投资组合。

（1）估值因子

通过单因子统计模型，建立不同估值因子与行业股价涨幅之间的联系，从而定期测试及比对各因子的有效性，最终确定模型中不同行业的估值选股因子。

本基金所采用的估值因子库包含但不限于：市现率（PCF）、市销率（PS）、历史市盈率（trailing PE）、未来12个月市盈率（forward 12m PE）、市净率（PB）等价值因子。

（2）情绪因子

通过对投资者情绪的捕捉，有助于对股票未来价格走势的延续性进行判断。成交量及换手率的活跃程度，配合股票价格走势（动量、反转等指标），通过模式识别技术，可以挖掘股价走势正处于上升通道的个股。

3、债券投资策略

本基金将采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架，对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

4、权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，充分利用来达到控制风险、实现保值和锁定收益等目的。

（十）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：沙深300指数收益率＊75%+中证全债指数收益率＊25%。

沙深300指数和中证全债指数具有广泛的市场代表性和较高的透明度，选用该业绩标准能够较为忠实反映本基金的风险收益特征，同时也能比较易切地体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

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指数时，本基金可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（十一）风险收益特征

本基金属于股票型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的投资品种。一般情况下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

（十二）基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，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2012年9月30日，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 | 87,961,524.18 | 90.40 |
| | 其中：股票 | 87,961,524.18 | 90.40 |
| 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 | 8,820,656.09 | 9.07 |
| 6 | 其他资产 | 518,198.55 | 0.53 |
| 7 | 合计 | 97,300,378.82 | 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 | 1,389,626.54 | 1.45 |
| B | 采掘业 | 6,216,969.86 | 6.47 |
| C | 制造业 | 52,081,115.95 | 54.24 |
| C0 | 食品、饮料 | 3,844,122.77 | 4.00 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 6,111,041.53 | 6.36 |
| C2 | 木材、家具 | 300,155.94 | 0.31 |
| C3 | 造纸、印刷 | 679,578.54 | 0.71 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 8,160,695.63 | 8.50 |
| C5 | 电子 | 3,057,684.81 | 3.18 |
| C6 | 金属、非金属 | 7,636,288.85 | 7.95 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 19,168,557.97 | 19.96 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,895,870.42 | 1.97 |
| C99 | 其他制造业 | 1,227,119.49 | 1.28 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,242,068.40 | 1.29 |
| E | 建筑业 | 982,038.40 | 1.02 |
| F | 交通运输、仓储业 | 4,205,637.75 | 4.38 |
| G | 信息技术业 | 864,788.67 | 0.90 |
| H | 批发和零售贸易 | 9,398,839.60 | 9.79 |
| I | 金融、保险业 | 3,508,302.01 | 3.65 |
| J | 房地产业 | 5,102,491.68 | 5.31 |
| K | 社会服务业 | 1,284,753.22 | 1.34 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 1,684,892.10 | 1.75 |
| | 合计 | 87,961,524.18 | 91.61 |

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 | 000527 | 美的电器 | 117,056 | 1,074,574.08 | 1.12 |
| 2 | 600383 | 金地集团 | 208,850 | 1,050,515.50 | 1.09 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 47,520 | 1,012,176.00 | 1.05 |
| 4 | 000776 | 广发证券 | 73,154 | 994,894.40 | 1.04 |
| 5 | 601898 | 中煤能源 | 134,839 | 956,008.51 | 1.00 |
| 6 | 000425 | 徐工机械 | 82,290 | 876,388.50 | 0.91 |
| 7 | 600029 | 南方航空 | 246,328 | 839,978.48 | 0.87 |
| 8 | 002304 | 洋河股份 | 6,307 | 788,375.00 | 0.82 |
| 9 | 600801 | 华新水泥 | 65,937 | 780,694.08 | 0.81 |
| 10 | 000338 | 潍柴动力 | 38,385 | 743,133.60 | 0.77 |

4、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。

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

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）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出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 | 500,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 9,211.75 |
| 4 | 应收利息 | 3,061.50 |
| 5 | 应收申购款 | 5,925.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 518,198.55 |

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。

5）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 | 000527 | 美的电器 | 1,074,574.08 | 1.12 | 临时停牌 |

6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（十三）基金的业绩

基金管理人依