

(上接A18版)

电话:021-60897869,0571-28829790
联系人:周煜斐
客户服务电话:400-0766-123
网址:www.fund123.cn
56、代销机构
名称:上海天天基金销售有限公司
住所:浦东新区峨山路613号9幢561室
办公地址:徐汇区龙山路196号3C座9楼
法定代表人:其实
电话:021-54509888
联系人:纳小丹
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
57、代销机构
名称:上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中街685弄37号4楼449室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中心68号时代金融中C8楼601
法定代表人:杨文斌
电话:021-58870011-6706
联系人:陈心怡
客户服务电话:400-7009-665
网址:www.ehowbuy.com
58、代销机构
名称:北京展恒基金销售有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦8层
法定代表人:闫振杰
电话:010-62000088-8288
联系人:焦琳
客户服务电话:400-8886-661
网址:www.myfund.com
59、代销机构
名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市金山区廊下镇漕浦公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中心68号时代金融中C8楼601
法定代表人:汪静波
电话:021-38500630
联系人:姚思玮
客户服务电话:400-8215-399
网址:www.noah-fund.com
60、代销机构
名称:深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、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、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩萍
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客户服务电话:400-6788-887
网址:www.zlfund.cn
61、代销机构
名称:和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市浦东新区东方路1818号保利广场E座18楼
法定代表人:王莉
电话:021-68419822
联系人:周殊
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
62、代销机构(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内
法定代表人:李招弟
电话:010-59383923
联系人:高晓芳
客户服务电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
(二) 注册登记机构
名称: 国联安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
法定代表人: 庾启斌
电话:021-38992888
传真:021-50151880
网址:www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com
联系人:仲晓峰
(三) 出具法律意见书的律师事务所
机构名称:上海源泰律师事务所
注册地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海
(四) 审计基金财产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所
注册地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
办公地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
负责人:蔡廷基
联系电话:021-53594666
联系传真:021-62881889
联系人:黎俊文
经办注册会计师:王国磊、陈彦君

五、基金名称
本基金名称:国联安德盛精选股票证券投资基金
六、基金的类型
本基金类型:契约型开放式(股票型)
七、基金份额的申购与赎回
(一) 申购和赎回的数额和价格
1、申购份额、余额的处理方式
(1) 申购份额、余额的处理方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应费用后,以当日基金份额净值为基准计算,计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。
(2) 赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。
2、申购份额的计算
如果投资者选择交纳前端申购费,则申购份额的计算方法如下:
净申购金额=申购金额/(1+前端申购费率)
前端申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
例一:某投资者通过本公司直销柜台申购本基金的养老金客户(除外)投资60万元申购本基金,申购费率为1.0%,假设申购当日基金份额净值为1.120元,如果其选择前端的收费方式,则其可得到的申购份额为:
净申购总金额=600,000/(1+1.0%)=594,059.41元
前端申购费用=600,000-594,059.41=5,940.59元
申购份额=594,059.41/1.120=530,410.19份
(2) 后端收费模式:
如果投资者选择交纳后端申购费,则申购份额的计算方法如下:
申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值
例二:某投资者投资60万元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.120元,如果其选择后端收费方式,则其可得到的申购份额为:
申购份额=600,000/1.120=535,714.29份
即:投资者投资60万元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.120元,则其可得1535,714.29份基金份额。
(3) 赎回金额的计算
如果投资者在申购时选择交纳前端申购费,则赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-赎回费用
如果投资者在申购时选择交纳后端申购费,则赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率
赎回费用=赎回总额×赎回费率
赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用
例一:某投资者赎回持有不超过365天的1000份基金份额,该投资者在购买这1000份基金时,选择前端的收费方式。赎回对应的赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值为1.120元,则其可得到的赎回金额为:
赎回费用=1000x1.120x0.5%=5.6元
赎回金额=1000x1.120-5.6=1114.40元
即:投资者赎回本基金1000份基金份额,假设赎回当日基金份额净值为1.120元,则其可得到的赎回金额为1114.40元。
例二:某投资者赎回持有超过365天但不超过730天的1000份基金份额,该投资者在购买这1000份基金时,选择后端收费方式。赎回对应的赎回费率为0.25%,假设赎回当日基金份额净值为1.120元,投资者对应的后端申购费是1.3%,申购时的基金份额净值为1.050元,则其可得到的赎回金额为:
赎回总额=1000x1.120=1120元
后端申购费用=1.050x1000x1.3%=13.65元
赎回费用=1120x0.25%=2.80元
赎回金额=1120-13.65-2.8=1103.55元
4、基金份额资产净值的计算
基金份额净值=基金资产净值总额/发行在外的基金份额总数
本基金日基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公布。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。
(二) 基金的申购费和赎回费
1、申购费用
(1) 本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
(2) 申购费用按申购金额采用比例费率。基金投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔申购金额计算。具体费率如下:
① 通过本公司直销柜台申购本基金的养老金客户适用的申购费率如下表:

	申购金额(含申购费)	费率
	50万以下	1.50%
前端收费模式	50万(含)至150万	1.00%
	150万(含)至500万	0.60%
	500万(含)及以上	每笔交易1000元
后端收费模式	持有时间	费率
	持有1年以下	1.60%
	持有1年(含)至3年	1.30%
	持有3年(含)至5年	0.60%
	持有5年(含)及以上	0.00%

投资者通过国联安基金网上直销平台申购本基金可享受前端申购费率优惠,具体优惠申购费率敬请以最新的相关公告为准。
基金管理人不对申购金额上限,但各银行卡具体的申购上限要遵守各银行网上银行上上限标准。本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求,并依据相关法律法规的要求提前进行公告。
本基金并适时参加相关代销机构申购费率优惠活动,具体活动细则及费率情况详情参见基金管理人有关公告。该等申购费率优惠活动最终解释权归相关代销机构所有,活动具体规定如有变化,敬请基金投资人留意相关代销机构的有关公告。
2、赎回费用
赎回费用由基金赎回人承担,赎回费用的25%归基金资产,其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。
本基金的赎回费率如下:

持有时间	费率
持有1年以下	0.50%
持有1年(含)至2年	0.25%
持有2年(含)及以上	0.00%

注:其中1年为365天计算。
3、基金管理人可以在法律法规规定和基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式,最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。如费率发生变更,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。
4、转换费用
基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记、同一收费模式的开放式基金。
(1) 适用基金范围:
本基金转换业务适用的基金范围为:本基金及本基金管理人旗下管理的国联安德盛稳健证券投资基金(基金简称:国联安稳健混合;基金代码:256010)、国联安德盛小盘精选证券投资基金(基金简称:国联安小盘精选混合;基金代码:257010)、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金(基金简称:国联安安心成长混合;基金代码:253010)、国联安德盛精选股票证券投资基金(基金简称:国联安精选股票;基金代码:前瑞257020、后瑞257021)、国联安德盛优势股票证券投资基金(基金简称:国联安优势股票;基金代码:前瑞257030、后瑞257031)、国联安德盛红利股票证券投资基金(基金简称:国联安红利股票;基金代码:前瑞257040、后瑞257041)、国联安德盛增利债券证券投资基金(基金简称:国联安增利债券;基金代码:A类2563020、B类2563021)、国联安主题驱动股票型证券投资基金(基金简称:国联安主题驱动股票;基金代码:2567050)、国联安安心增值债券型证券投资基金(简称:国联安安心增值债券;基金代码:2563030)、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金简称:国联安上证商品ETF联接;基金代码:257060)、国联安货币市场证券投资基金(基金简称:国联安货币;基金代码:A级2563050、B级2563051)、国联安优选行业股票型证券投资基金(基金简称:国联安优选行业股票;基金代码:2567070)、国联安中债信用债指数增强发起式证券投资基金(基金简称:国联安中债信用债指数增强;基金代码:2563070)、国联安保本混合型证券投资基金(基金简称:国联安保本混合;基金代码:000068)、国联安中证中期策略指数证券投资基金(基金简称:国联安中证中期;基金代码:000060)和国联安中证医药100指数证券投资基金(基金简称:国联安医药100指数;基金代码:000065)。
本公司今后发行的其他开放式基金的基本转换业务另行公告。

(2) 适用销售机构:
国联安基金管理人网上直销平台、国联安基金管理有限公司直销柜台、中国银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信万通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、中信证券(香港)有限责任公司、华宝证券有限责任公司、江海证券有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司和万银财富(北京)基金销售有限公司。
具体基金管理人可根据情况变更或增减上述销售机构,并将另行公告。
具体可转换基金为各销售机构已销售并开通转换业务的基金。
(3) 基金转换及转换份额的计算
① 进行基金转换的总费用包括转换手续费、转出基金的赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费三部分。
(A) 转换手续费费率等费,如基金转换手续费费率调整将另行公告。
(B) 转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率
其中:转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值
目前,本公司旗下基金赎回费率如下:

基金名称	持有时间	费率
国联安稳健混合	全部	0.50%
国联安小盘精选混合	持有1年以下	0.50%
国联安安心成长混合	持有1年(含)至2年	0.25%
国联安精选股票	持有2年(含)及以上	0.00%
国联安优势股票	持有1年以下	0.50%
国联安红利股票	持有1年(含)至2年	0.30%
国联安主题驱动股票	持有2年(含)及以上	0.00%
国联安上证商品ETF联接	持有1年以下	0.50%
国联安悦动混合	持有1年(含)至2年	0.20%
国联安悦选行业股票	持有2年(含)及以上	0.00%
国联安增利债券A	持有90天以下	0.30%
	持有90天以上	0.00%
国联安增利债券B	持有30天以下	0.75%
	持有30天(含)及以上	0.00%
	持有30天以下	0.90%
国联安安心增值债券	持有30天以上(含)至1年	0.10%
	持有1年(含)至2年	0.05%
	持有2年(含)及以上	0.00%
国联安中债信用债指数增强	持有1年以下	1.50%
	持有1年(含)至2年	1.00%
	持有2年(含)及以上	0.00%
国联安保本混合	持有1.5年(含)至3年	1.00%
	持有3年(含)以上	0.00%
国联安货币	全部	0.00%

上述赎回费率可能根据本公司公告而进行调整。(C) 申购补差费=(转出金额-转出金额×转出基金赎回费率)×申购补差费率(1、申购补差费率)
投资者通过网上直销平台办理前端收费模式下本基金与本公司旗下其他开通基金转换业务的开放式基金之间的基金转换业务,享受转换费中相应前端申购补差费率的优惠,其他转换费率标准不变。在确定基金转换补差费率时,对于转出基金、转入基金的标准申购费率高于0.6%的,申购费率按基金对应的4折优惠;申购补差费率,但优惠申购费率不得低于0.6%。转出基金、转入基金的标准申购费率等于或低于0.6%的,则依据标准申购费率计算。
基金管理人有权根据业务情况调整上述交易费用,并依据相关法律法规要求进行公告。
其中:转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值
目前基金的申购费率如下:

基金名称	申购金额(含申购费)	费率
国联安稳健混合	100万以下	1.50%
国联安小盘精选混合	100万(含)至500万	1.00%
国联安安心成长混合	500万(含)以上	每笔交易1000元
国联安精选股票(前瑞)	50万以下	1.50%
国联安优势股票(前瑞)	50万(含)至150万	1.00%
国联安红利股票(前瑞)	150万(含)至500万	0.60%
国联安主题驱动股票	500万(含)及以上	每笔交易1000元
国联安上证商品ETF联接	100万以下	1.50%
国联安悦动混合	100万(含)至500万	0.70%
	500万(含)以上	每笔交易1000元
国联安悦选行业股票	50万以下	1.50%
	50万(含)至100万元	1.20%
	100万(含)至500万元	0.80%
	500万(含)至1000万元	0.30%
国联安增利债券A	100万以下	0.70%
	100万(含)以上	每笔交易1000元
国联安增利债券B	100万以下	1.00%
	100万(含)至300万	0.80%
	300万(含)至500万	0.40%
	500万(含)及以上	每笔交易1000元
国联安保本混合	100万以下	1.20%
	100万(含)至500万	0.70%
	500万(含)至1000万元	0.20%
国联安医药100指数	100万(含)以上	每笔交易1000元
	持有1年以下	1.60%
	持有1年(含)至3年	1.30%
	持有3年(含)至5年	0.60%
	持有5年(含)及以上	0.00%
国联安红利债券A	100万以下	0.80%
国联安安心增值债券	100万(含)至300万	0.50%
国联安中债信用债指数增强	300万(含)至500万	0.30%
	500万(含)及以上	每笔交易1000元
国联安增利债券B	全部	0.00%
国联安货币	全部	0.00%

前端的申购费之间转换的申购补差费率按转出金额对应转入基金的标准申购费率和转出基金的标准申购费率予以依据来计算。
(D) 其他销售机构办理基金转换业务适用,因此转换补差费率在开通时另行公告。
① 转换份额的计算公式:
(A) 转入份额=转入金额/转入基金当日基金单位资产净值
(B) 转入金额=转出金额-转换费用
(C) 转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值
(D) 转换费用=转换手续费+赎回费+申购补差费
注:转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。
② 基金转换业务示例:
例:某投资者于某日通过本公司网上交易平台将其持有的国联安精选股票基金600,000份转换为国联安安心混合基金,该投资者使用的是行(卡)非银联支付)。假设转换申请受理当日国联安精选股票基金的基金单位资产净值为1.250元,国联安安心混合基金的基金单位资产净值为1.050元,假设该投资者持有国联安精选股票基金不满1年,则该档档卡下,国联安精选网上交易转换为国联安安心成长的上交易申购补差费率为0.75%-0.6%=0.15%,则该投资者最终得到的安心成长的份额计算为:
国联安精选股票基金赎回费=转出份额×国联安精选股票基金当日基金单位资产净值×国联安精选股票基金赎回费率=600,000x1.250x0.5%=3,125元
申购补差费=(转出金额-转出金额×转出基金赎回费率)×申购补差费率(1+申购补差费率)=(500,000x1.250-500,000x1.250x0.5%)×0.15%/(1+0.15%)=931.42元
转入金额=转出份额×国联安精选股票基金当日基金单位资产净值-赎回费-申购补差费=600,000.00x1.250-3,125-931.42=620,943.58元
转入份额=转入金额/国联安安心混合基金当日基金单位资产净值=620,943.58/1.050=591,374.04份

(4) 业务规则:
① 基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时,转出方的基金必须处于可赎回状态,转入方的基金必须处于可申购状态。
② 可赎回基金转换未知价,即以申请受理当日转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。
③ 正常情况中,基金转出与过户登记人将在T+1日对投资者T日的基金转换业务申请进行有效性确认。在T+2日后(包括该日)投资者可通过本公司直销业务平台查询基金转换的成交情况。
④ 目前,每次对上述单只基金转换业务的申请原则上不得低于100份基金份额;且如因某笔基金转出业务导致基金单个交易账户的基金份额余额少于100份时,基金管理人将该交易账户保留的基金份额余额一次性全额转出。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。
⑤ 单个开放日单只基金净赎回申请(赎回申请份额与转出申请份额总数,扣除申购申请份额与转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日该基金总份额的10%时,即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时,基金转出与基金赎回具有相同的优先权,基金管理人可根据基金资产组合情况,决定全额转出或部分转出,并且对于基金转出和基金赎回,将采取相同比例比例确认。在转出中申请得到部分确认的情况下,未确认的转出申请将不予以顺延。
⑥ 目前,基金转换业务中,基金转换的基金份额,只能转换为其他前端收费模式的基金份额,后端收费模式的基金份额只能转换为其他后端收费模式的基金份额。
(5) 暂停基金转换的情形及处理:
出现下列情况之一时,基金管理人可以暂停基金转换业务:
① 不可抗力导致基金无法正常运转。
② 证券交易所所在交易时无法正常开市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
③ 因市场剧烈波动或其他原因出现连续巨额赎回,基金管理人认为有必要暂停接受该基金单位转出申请。
④ 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。
发生上述情形之一,基金管理人应立即向中国证监会备案并于规定期限内至少在一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时,基金管理人应最迟提前2个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登重新开放基金转换的公告。
(6) 重要提示:
① 基金发行期內不受基金转入交易申请,该基金成立并开放申购赎回业务后受理基金转换业务。新基金的转换规则,以本公司公告为准。
② 本招募说明书仅列明国联安稳健混合、国联安小盘混合、国联安安心混合、国联安精选股票、国联安优势股票、国联安红利股票、国联安增利债券、国联安悦动混合、国联安悦选行业股票、国联安中债信用债指数增强、国联安保本混合、国联安悦动混合和国联安医药100指数的转换业务示例。
③ 本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关事项,但最迟应在调整生效前2个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。
④ 本基金转换业务的解释权归本公司。

八、基金的投资目标
通过投资优质目标,业绩良好,管理规范的公司来获得长期稳定的收益。
九、基金的投资方向
本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金在股票投资方面的主要投资对象是具有创造能力的公司,主要体现在以下三个方面:经营获利能力、资本成本和增长能力。
在正常的市场情况下,本基金的资产配置的基本范围为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%;其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。当法律法规发生变化时,上述投资比例将按届时合法有效的法律法规予以修改,在报中国证监会备案后由基金管理人依法执行。
十、基金的投资策略及投资程序
本基金是股票型资产,在股票投资上主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时,适度把握宏观经济情况在资产配置。具体来说,本基金通过以下步骤进行股票选择:
首先,通过ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力,通过WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本;其次,将公司的获利能力和资本成本指标相结合,选择出创造价值高的公司;最后,根据公司的成长能力和估值指标,选择投资标的,构建股票组合。
投资管理流程分为投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资控制与监督、风险控制六个环节。
1、投资决策
为保障基金份额持有人利益,本基金管理人在投资研究过程中,将定期召开投资决策委员会会议和投资研究委员会,为投资决策提供决策的依据。
投资决策委员会由目前前发研究、金融政策、货币政策、利率水准等总体经济数据及风险预算模型测算的资产配置方案进行分析和讨论,对基金经理提交的报告进行讨论和表决,决定各基金在一段时期内的资产配置方案。
基金经理和研究定期召开的投资研究联席会议主要讨论可投资股票、确定股票库等,为基金提供投资建议。固定收益研究组和基金经理定期研究债券和可转债投资组合的构建与调整。
2、投资执行
(1) 基金投资决策报告的形成
风险预算由数量策略部和风险管理部定期制定,并不定期进行调整。数量策略部和风险管理部通过分析股票资产和债券资产的波动特征,利用风险预算模型和原理测算两类资产的配置比例,为投资决策委员会和基金经理的资产配置决策提供依据。
基金经理定期结合风险预算、国内外经济形势、市场走势及投资研究会议的讨论结果拟订《投资策略报告》,阐述自身的投资策略,并明确下一阶段股票、固定收益类证券、现金和融资的投资比例。
(2) 可投资证券选择库的建立和维护
每季度研究组和基金经理针对不同产业的投资,依据各公司的财务状况、盈利能力及未来成长性,提出可投资证券名单,讨论后确定可投资证券选择库,并上投投资决策。若证券选择库中公司的基本面有重大变化,研究员应及时提出最新的研究报告,并通知投资总监,在取得投资决策委员会同意后作相应调整。
(3) 核心证券库的建立和维护
研究员或基金经理对可投资证券选择库名单中的公司进行深入的研究和调研,并出具研究报告,经投资决策委员会讨论后列入基金的核心证券库。
(4) 固定收益证券和可转债组合的建立和维护
债券研究组和基金经理定期或不定期地对交易所、银行间等市场交易的固定收益证券和可转债等固定金融工具进行深入研究,根据对利率期限结构及其他市场因素判断,确定固定收益证券和可转债的投资对象和范围,并根据证券的市场走势和估值水平构建投资组合。
基金经理制定和调整投资组合时,原则上须选择核心证券库中的证券。研究员或基金经理对于核心证券库中的证券须持续跟踪其基本面及股价变化,并适时提出修正报告,以利益基金进行投资决策。
基金经理在投资分析的基础上进行投资组合管理,并对其投资组合负责。
3、投资执行
基金所有的交易行为都通过基金交易部统一执行,一切交易在交易资讯保密的前提下,依既定程序公开进行。
对于违反《基金法》、基金合同、投资决策委员会决议和公司投资管理制度的交易指令,交易部经理应暂停执行该等指令,及时通知相关基金经理,并向投资总监、监察稽核部汇报。
4、投资跟踪与总结
基金经理定期进行投资总结,对已发生的投资行为进行分析和总结,为未来的投资行为提供总结的方向。
基金经理定期向投资决策委员会提交所管理基金的《投资总结报告》,对其投资组合的表现进行分析,并对投资组合中的不足提出改进意见。
如果基金可投资证券选择库和核心证券库中的证券的基本面情况有变化,该基金经理可提议召开临时研究联席会议,讨论是否要修改证券选择库和核心证券库。
基金经理应密切跟踪投资研究结论,认为有必要修改资产配置方案或重大投资项目方案的,应起草《投资策略报告》或《重大投资项目建议书》,经投资总监审阅后报投资决策委员会讨论决定。
5、投资执行与监督
基金事务部清算员通过交易数据的核对,对当日交易操作进行复核,如发现有违反《证券法》、《基金法》、基金合同、公司相关管理制度的交易操作,须立刻向投资总监汇报,并及时通报监察稽核部、风险管理部、相关基金经理、基金交易部。
基金交易部负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。
6、风险控制
基金投资管理过程中的风险控制包括两个层次,一个层次是基金投资管理组织体系内部的风险管理,另一个层次是独立的风险管理部门(包括风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部)对投资管理过程的风险监控。
投资总监负责基金投资管理全流程的风险控制工作,一方面在投资管理过程中切实贯彻风险控制的原则;另一方面根据独立风险管理机构(包括风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部)的风险评估意见,及时制定相应的改进和应对措施,并责成相关部门和人员切实落实和执行。
十一、基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为沪深300指数×85%+上证国债指数×15%。
如果今后市场有其他代表性更强的业绩比较基准推出,本基金可以在经过适当的程序后变更业绩比较基准。
本基金为股票型基金,在考虑了该基金投资组合的投资标的,构建流程以及市场上各个股票指数的选股方式和历史情况后,我们选择沪深300指数作为其基金投资组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的上证国债指数。
本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位将不低于85%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。
十二、基金的风险收益特征
中高风险、较高的预期收益。
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。
本基金托管人——华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。本报告组合报告所载数据截至2013年12月31日,本报告财务资料未经审计师审计。
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	3,006,549,882.31	80.94
2	其中:股票	3,006,549,882.31	80.94
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	294,492,761.74	7.93
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	350,411,619.03	9.43
11	其他资产	63,289,944.58	1.7
12	合计	3,714,744,207.66	100

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	采矿业	97,000,000.00	2.69
C	制造业	2,294,799,882.31	63.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	179,400,000.00	4.98
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	292,250,000.00	8.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	143,100,000.00	3.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	3,006,549,882.31	83.38

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	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	伊利股份	6,180,000	241,514,400.00	6.70
2	东方财富	6,000,000	237,360,000.00	6.58
3	华东医药	3,900,000	179,400,000.00	4.98
4	格力电器	5,200,000	169,832,000.00	4.71
5	国电南瑞	10,000,000	148,700,000.00	4.12
6	科大讯飞	3,000,000	143,550,000.00	3.98
7	华侨城A	27,000,000	143,100,000.00	3.97
8	万华化学	6,700,000	138,690,000.00	3.85
9	恒瑞医药	3,600,000	136,728,000.00	3.79
10	上海医药	3,000,000	126,690,000.00	3.51

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、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
2) 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1) 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。
2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
3) 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。
10、投资组合报告附注
1) 本基金报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除上海家化外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制