

(上接B077版)

网址: www.cmabstock.com
(89) 厦门证券有限公司
注册地址: 厦门市海沧西路2 号富嘉大厦十七楼
办公地址: 厦门市海沧西路2 号富嘉大厦十七楼
法定代表人: 傅晓辉
电话: (0592) 5161642
传真: (0592) 5161140
客户服务电话: (0592) 5163688
网址: www.xmzq.cn
(90) 爱建证券有限责任公司
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: 杨华俊
电话: (021) 32229888
传真: (021) 62878701
客户服务电话: 4001962502
网址: www.ajzq.com
(91) 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、三十一层
办公地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦十一、二十九、三十一、三十三层
法定代表人: 吴昊
电话: (0755) 83007041/ 83007166
传真: (0755) 83007034
客户服务电话: (0755) 26982993
网址: www.ydsec.com
(92) 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: 宋永毅
电话: (010) 58569007
传真: (010) 58569052
客户服务电话: 58569118
网址: www.hrsec.com.cn
(93) 财达证券有限责任公司
注册地址: 河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
办公地址: 河北省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: 崔建强
电话: (0311) 86028442
传真: (0311) 66002614
客户服务电话: 4000128888
网址: www.s1000.com
(94) 天华证券有限责任公司
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: 武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座3楼
法定代表人: 余海华
电话: (027) 87619889
传真: (027) 87619889
客户服务电话: (028) 98712334
网址: www.ttzq.com
(95) 中天证券有限责任公司
注册地址: 沈阳市和平区光荣街23 甲
办公地址: 沈阳市和平区光荣街23 甲
法定代表人: 马功勋
电话: (024) 12325606
传真: (024) 180010315
客户服务电话: (024) 12325606
网址: www.atstocken.com
(96) 大连证券股份有限公司
注册地址: 大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大连期货大厦38、39层
办公地址: 大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大连期货大厦38、39层
法定代表人: 李红光
电话: (0411) 33673301
传真: (0411) 33673219
客户服务电话: 4008—169—169
网址: www.dlstock.com.cn
(97) 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) 166045608
传真: (010) 166045608
客户服务电话: (010) 166045678
网址: www.txsec.com.cn或jijin.txsec.com
(98) 上海信证证券有限责任公司
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
法定代表人: 杨晓敏
电话: (021) 38784818
传真: (021) 168775878
客户服务电话: (021) 38784818
公司网站: www.shxzq.com
(99) 上海好买基金销售有限公司
注册地址: 上海市虹口区场中路685 弄37 号4 号楼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: 021—68509916
客服电话: 400—700—9665
网址: www.ehowbuy.com
(100) 杭州聚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: 浙江省杭州市西湖区江南大道3688号12楼
法定代表人: 陈磊
客服电话: 4000—766—123
(101) 上海天天基金销售有限公司
注册地址: 浦东新区峨山路613号6幢561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
客服电话: 400—181—8188
网址: www.1234567.com.cn
(102) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址: 上海市浦东新区浦大道55号裕景国际B座16层
法定代表人: 张怀伟
客服电话: 400—820—2899
传真: 021—68757698
网址: www.e-rich.com.cn
(103) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 浙江省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: 易峰
电话: 0571—88208879
传真: 0571—88200423
客服电话: 0571—88920897 4008—773—772
公司网站: www.5ifund.com
(104) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址: 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大街2号民建大厦2层
法定代表人: 闫振杰
客服电话: 400—888—6661
传真: (+86) 1062000088—8802
网址: www.myfunds.com
(105) 众升财经(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25号楼3201F3201单元
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号院25号楼3201F3201单元
法定代表人: 李相昭
电话: 010—56303923
传真: 010—59330734
客服电话: 4000800609
公司网站: www.wy-fund.com
(106) 深圳众益基金销售有限公司
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、1单元
办公地址: 深圳市罗湖区翠园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人: 薛峰
客服电话: 4006—788—787
传真: 0755—82080798
网址: www.zifund.com www.jimw.com
(107) 联讯证券股份有限公司
注册地址: 广东省惠州市江北东江3865号广播电视新闻中心三、四层
办公地址: 广东省惠州市江北东江3865号广播电视新闻中心三、四层
法定代表人: 涂卿
客服电话: 95564
网址: www.lxqz.com.cn
(108) 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18层
办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利广场8层18F
法定代表人: 王莉
联系人: 吴卫东
电话: 021—20838767
传真: 021—20838879
(109) 中国国际贸易有限公司
注册地址: 北京市朝阳区建国门 外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址: 北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人: 王兵
客服电话: 96162
公司网站: www.cifco.net
(110) 北京朝晖基金销售有限公司
注册地址: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
办公地址: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
法定代表人: 罗细安
联系电话: 010-67000888
传真号码: 010-67000888—6000
客户服务电话: 400—001—8811
网址: www.zvcv.com.cn
(112) 太平洋证券股份有限公司
注册地址: 云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址: 云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人: 李长伟
客服电话: 0871—68858130
网站: http://www.tpyz.com.cn
(113) 广州证券股份有限公司
注册地址: 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主楼19层、20层
办公地址: 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主楼19层、20层
法定代表人: 邱三发
联系人: 林洁茹
联系电话: 020—88839699
传真: 020—88839654
客户服务电话: 020—83963933
网址: www.gzs.com.cn
(114) 财通证券有限责任公司
注册地址: 杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址: 杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人: 沈卫宁
客服电话: 0571—96336
网址: www.ctsec.com

(115) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址: 上海市虹口区 临平路360号9层3724室
办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路32号东润园区C座6 2楼
法定代表人: 王静瑜
电话: 400—821—5399
电话: 021—38600676
传真: 021—38600777
网址: www.noah-fund.com
(116) 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1幢11层
办公地址: 北京市朝阳区建国门 外光华路16号中国中期大厦A座11层
法定代表人: 路瑶
电话: 010—58639718、59539728
传真: 010—58097110
客服电话: 06162、4008898160
网址: www.cifcofund.com
(117) 深圳市新华德证券投资咨询有限公司
住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座8层
法定代表人: 陈楠
电话: 010158325386
电话: 010158325282
客户服务电话: 400—880—7771
网址: https://t.lxjq.com/
(118) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号1807—5室
办公地址: 上海市黄浦区中山东路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人: 张磊
联系电话: 021—33323998
传真电话: 021—33323993
客户服务热线: 400—820—2919
网址: fund.tundtrade.com
(119) 泉州银行股份有限公司
注册地址: 泉州市云鹿路3号
办公地址: 泉州市云鹿路3号
法定代表人: 傅力争
联系电话: 0595—22551071
传真号码: 0595—22556215
网址: www.qzcbank.com
(120) 一路财富(北京)信息科技有限公司
地址: 北京市西城区阜成门 外大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人: 吴雪涛
客服电话: 4000011566
网址: www.yilucaifu.com
(121) 海富通基金管理有限公司
注册地址: 上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址: 上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
法定代表人: 刘惠
联系电话: 021—80133988
传真号码: 021—80133413
客户服务电话: 400—948—1016
网址: http://www.fundhaiyin.com
(122) 北京恒天明泽基金销售有限公司
地址: 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人: 梁斌
客服电话: 4008080618
网址: www.chtfund.com
(123) 上海陆家嘴国际金融资产交易市场股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号13楼
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号13—15楼
法定代表人: GIBB RICHGROY DEAN
客户服务热线: 4008 0666 18
网址: http://www.lu.com/
(124) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址: 中国 上海 自由贸易试验区富特路277号3层310室
办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号9号楼4层
法定代表人: 燕斌
客户服务电话: 400—046—6788
网址: www.66zichan.com
(125) 前海富济财富管理有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址: 深圳市南山区高新科技园七惠康集团二期418室
法定代表人: 齐小贺
客户服务电话: 0755—83999913
网址: www.jinqianwo.com
(126) 北京乐融多源投资咨询有限公司
地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人: 董浩
客户服务热线: 400—068—1176
网址: www.jimutfund.com
(127) 大秦基金投资管理有限公司
注册地址: 南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址: 上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人: 袁祺明
联系电话: 021—22267987
传真号码: 021—22268089
网址: www.dttfund.com
(128) 珠海盈米投资管理有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道1号宝利国际广场南塔12楼
法定代表人: 肖雯
联系电话: 020—89629021
传真号码: 020—89629011 网址: 192/75285,pe168.com/
(129) 创信证券有限责任公司
注册地址: 四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
办公地址: 四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人: 吴玉明
客服电话: 4008—366—366
网址: http://www.hxzq.cn
(130) 上海利得基金销售有限公司
注册地址: 上海市宝山区蕴川路5475号103室
办公地址: 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人: 沈继伟
联系电话: 86—021—50683533
传真号码: 86—021—50683633
客户服务电话: 4000676266
网址: www.leadbank.com.cn
(131) 北京禧德汇富投资咨询有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门 内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址: 北京市东城区建国门 内大街18号恒信中心办公楼一座2202室
法定代表人: 李振
电话: 05118020
传真: 05117472
客户服务热线: 400—066—9355
网站: www.kstseasure.com
(132) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼2—45室
法定代表人: 彭运华
客户服务电话: 4008909988
网址: www.jlcc.com
(133) 泰信财富投资管理有限公司
地址: 北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8095房间
法定代表人: 李静
客户服务电话: 400—168—7575
网址: www.taixinfund.com
(134) 上海聚财财富基金销售有限公司
地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602—115室
法定代表人: 陈耀武
客户服务热线: 4000 178 000
网址: www.lxinqianfund.com
(135) 上海中正达广投资管理有限公司
地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人: 黄欣
客户服务热线: 400—6767—523
网址: www.zzwalth.cn
(136) 苏州银行股份有限公司
地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路728号
法定代表人: 王兰凤
客服电话: 96067
网址: www.suzhoubank.com
(137) 国联证券股份有限公司
(138) 国联证券股份有限公司
名称: 华安基金管理有限公司
(注) 注册登记机构
名称: 华安基金管理有限公司
注册地址: 中国 上海 自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期31—32层
法定代表人: 朱学华
电话: (021) 38869999
传真: (021) 33627062
联系人: 赵良
客户服务电话: 40088—50009
(三) 律师事务所和经办律师
律师事务所: 通力律师事务所
地址: 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) 31359666
传真: (021) 31359600
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(特殊普通合伙)
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
首席合伙人: 李丹
联系电话: (021) 23238888
传真: (021) 23238800
联系人: 周伟
经办会计师: 单峰、周伟
四、基金名称
本基金名称: 华安中小盘成长混合型证券投资基金。
五、基金类型
本基金类型: 契约型开放式。
六、基金的投资目标
通过主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票, 在严格控制投资风险的前提下, 实现基金资产的持续增值。
七、基金的投资方向
本基金为混合型基金, 投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。其中, 股票投资的比例范围为基金资产的60%—95%; 债券、资产、权证支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围70—40%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以内。本基金将不低于80%的股票资产投资于国内A股市场具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票。
基金管理人每年将对中国A股市场上的股票投资市值从小到大排序并相加, 累计流通市值达到总市值70%的股票列入中小盘股。基金所有持有股票价格的相对变化而导致中小盘股投资比例低于上述规定的不在限制之内, 但基金管理人应在合理期限内予以调整, 最长不超过六个月。
此外, 在法律法规或监管机构允许下不超过基金投资的其他品种, 基金管理人可在投资适当程序后, 可以将其纳入投资范围; 如法律法规或中国证监会变更投资品种的范围和投资比例, 基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定, 不需经基金份额持有人大会审议。
八、基金的投资策略
本基金主要依靠基金管理人研究优势, 将科学有效的选股方法与主动、灵活的择时操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程, 在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司成长发展的基础上, 积极把握备选股票的投资机会, 为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。
本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测, 并利用公司研究开发的各类数量模型工具, 分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征, 确定合适的资产配置比例。同时, 本基金将定期或不定期地进行资产配置调整, 以达到规避风险及提高收益的目的。
2、股票投资策略
本基金认为, 公司未来盈利的增长是股价上涨的主要驱动因素, 因此将优先投资于现阶段估值水平较低、具有持续成长潜力的中小盘股票。
首先, 本基金将采用定性分析与定量分析的方法, 主要选择成长潜力较大的中小市值上市公司, 列入本基金的重点备选股票库。在选股的量化指标中, 主要考虑包括主营利润增长率、息税前利润增长率、净资产收益率、价值成长比率、市净率、市盈率等指标。
然后, 本基金将对有成长潜力的上市公司进行进一步案头研究和实地调研, 深入研究企业的基本面。在此过程中, 本基金管理人将凭借其研究平台, 由研究员对上市公司基本面对进行深度研究, 结合定量分析的结果对上市公司做出综合评估。同时, 对企业在未来两到三年的成长性做出预测, 优选成长性高、有持续成长能力、价值被市场相对低估的公司, 纳入本基金的投资备选库。
其中, 在公司基本面的分析上, 本基金管理人将着重考察:
(1) 公司所处的行业未来发展前景及公司在本行业内地位分析;
(2) 产品市场分析, 包括产品生产能力分析、上下游产品分析、替代产品分析, 考察企业是否充分把握行业发展机遇, 保持领先;
(3) 公司的竞争力分析, 包括公司管理素质及应变能力、市场营销能力、技术创新能力、品牌、专利权、客户资源等;
(4) 公司财务状况及财务管理能力;
(5) 公司潜在风险及应对措施分析。
除此之外, 本基金还可以以分散投资于其他具有成长潜力的股票, 这部分股票由研究员提交投资建议报告, 经基金经理和投资决策委员会审议后确定。
最后, 基金经理将在股票备选库中通过对股票价格与价值相对波动和偏离程度的分析来掌握买卖时机, 在股价的波动中适时实现收益。
3、债券投资策略
本基金可投资于国债、金融债、企业债和公司可转债债券等债券品种, 基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和公允价值因素的综合评估, 合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例, 构造投资组合。
在选择国债品种中, 本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险, 根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合; 在选择金融债、企业债品种时, 本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务状况安全性、历史违约/担保记录等, 本基金还将关注可转换债券与其所对应股票价格的相对变化, 综合考虑可转换的市场流动性等因素, 决定投资可转换的品种和比例, 捕捉其套利机会。
4、权益投资策略
本基金在实现权益投资时, 将通过对权益投资的证券基本面的研究, 结合权证定价模型寻求其合理估值水平, 谨慎地进行投资, 以追求较稳定的当期收益。
5、资产支持证券的投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等策略策略, 在严格遵守法律法规和基金合同基础上, 通过信用研究和流动性管理, 选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。
6、其他衍生工具投资策略
本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向, 一旦有新的产品推出市场, 将在届时相应法律法规的框架内, 制订符合本基金投资目标的投资策略, 同时结合对衍生工具的研究, 在充分考察衍生产品风险收益特征的前提下, 谨慎进行投资。
九、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准: 40%×天相中盘成长指数+ 40%×天相小盘成长指数+ 20%×H 指数。
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指数, 或者市场上出现更合适用于本基金业绩比较基准的股票指数时, 本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金, 基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金, 低于股票型基金, 属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
十一、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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2016年4月15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2016年3月31日。
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 2,390,364,128.06 93.05
其中: 股票 2,390,364,128.06 93.05
2 固定收益投资 88,040,000.00 3.45
其中: 债券 88,040,000.00 3.45
资产支持证券 — —
3 贵金属投资 — —
4 金融衍生品投资 — —
5 买入返售金融资产 300,000,000.00 12.16
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 56,776,778.29 2.22
7 其他各项资产 17,151,072.04 0.67
8 合计 2,552,331,900.09 100.00
2 报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业 10,395,000.00 0.43
B 采矿业 39,095,000.00 1.54
C 制造业 1,334,217,989.38 52.63
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 39,780,000.00 1.57
E 建筑业 30,648,204.48 1.21
F 批发和零售业 101,777,632.00 4.01
G 交通运输、仓储和邮政业 300,000,000.00 12.16
H 住宿和餐饮业 44,830,000.00 1.76
I 信息技术业 4,430,000.00 0.17
J 金融业 73,095,000.00 2.87
K 房地产业 177,632,000.00 6.99
L 租赁和商务服务业 170,691,000.00 6.72
M 科学研究和技术服务业 17,632,000.00 0.69
N 水利、环境和公共设施管理业 51,569,333.20 2.03
O 居民服务、修理和其他服务业 — —
P 教育 — —
Q 卫生和社会工作 2,812,500.00 0.11
R 文化、体育和娱乐业 — —
S 综合 — —
合计 2,390,364,128.06 94.10
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 002152 广电运通 7,000,000 167,160,000.00 6.58
2 601888 中国国旅 2,000,000 91,300,000.00 3.59
3 000438 深赛格 1,500,000 81,460,000.00 3.21
4 001979 招商公路 5,000,000 76,350,000.00 2.98
5 600518 康美药业 4,000,000 74,532,000.00 2.93
6 603091 禾盛新材 3,300,000 73,722,000.00 2.90
7 601336 新华保险 1,800,000 73,026,000.00 2.87
8 600896 中海油服 5,000,000 72,906,000.00 2.87
9 603799 华友铝业 3,400,000 72,796,000.00 2.87
10 000060 海信电器 4,200,000 69,888,000.00 2.76
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 国债券 88,040,000.00 3.47
2 央行票据 — —
3 金融债 — —
其中: 政策性金融债 — —
4 企业债 — —
5 企业短期融资券 — —
6 中期票据 — —
7 可转债 — —
8 同业存单 — —
9 其他 — —
10 合计 88,040,000.00 3.47
5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 019509 15国债09 680,000 68,034,000.00 2.69
2 019506 15国债06 200,000 20,006,000.00 0.78
6 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资产支持证券投资明细
无。
7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。
8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末没有投资股指期货。
9.2 本基金股指期货投资期的投资政策
无。
10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
无。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末没有投资国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
无。
11 投资组合报告附注
11.1 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, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
11.2 本基金投资的前十名股票中, 不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
11.3 其他各项资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 1,043,274.09
2 应收证券清算款 13,612,943.77
3 应收股利 — —
4 应收利息 2,230,976.52
5 应收申购款 263,991.86
6 其他应收款 — —
7 预付款项 — —
8 其他 — —
9 合计 17,151,072.04
11.4 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。
11.5 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、基金业绩
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财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的实际业绩并不代表其未来表现。投资有风险, 投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
(一) 基金净值表现
历史各时间段基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较(截止时间2015年12月31日)

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2007年04月10日(含)起至2012年12月31日止	73.04%	1.77%	52.40%	1.84%	20.64%	-0.07%
自2008年01月12日至2011年12月31日止	-67.68%	2.69%	-52.62%	2.53%	-15.07%	0.06%
自2009年11月1日起至2012年12月31日止	84.31%	1.66%	76.94%	1.74%	7.37%	-0.08%
自2010年11月1日起至2012年12月31日止	1.60%	1.33%	7.41%	1.37%	-6.72%	-0.04%
自2011年1月1日起至2012年12月31日止	-20.94%	1.15%	-27.62%	1.16%	-2.22%	-0.01%
自2012年11月1日起至2012年12月31日止	3.42%	1.05%	1.19%	1.21%	2.23%	-0.16%
自2013年11月1日起至2013年12月31日止	-1.16%	1.28%	0.46%	1.09%	-1.062%	0.19%
自2014年11月1日起至2014年12月31日止	24.00%	1.20%	20.90%	0.92%	3.73%	0.28%
自2015年11月1日起至2015年12月31日止	58.88%	2.84%	46.29%	2.13%	12.59%	0.71%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
十三、费用概览
(一) 与基金运作有关的费用
1. 基金管理人管理费
在通常情况下, 基金管理人费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:
$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理人费
E为前一日基金资产净值
基金管理人费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理人费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起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、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, 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:
$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
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、休息日, 支付日期顺延。
(二) 与基金销售有关的费用
1. 申购费
本基金通过对直销客户申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费。
养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金, 包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金计划以及集合计划、如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围, 并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。
通过基金管理人申购本基金各基金份额的申购费率如下所示:
(1) 投资者选择交纳前端申购费, 申购费率按申购金额采用比例费率。投资人在一天之内如果有有多笔申购, 适用费率按笔分别计算。具体费率如下:

申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<500万	1.00%
M≥500万	每笔1000元

(2) 投资者选择交纳后端申购费, 申购费率按持有时间递减, 申购费率见下表:

持有期限(Y)	后端申购费率
Y<1年	1.80%
1年≤Y<2年	1.50%
2年≤Y<3年	1.20%
3年≤Y<4年	1.00%
4年≤Y<5年	0.65%
Y≥5年	0.00

注: 一年指365天, 两年为730天, 依此类推。
对于投资者在基金净值前持有的基金份额及集中申购所得基金份额, 持有期自基金开放日常申购、赎回之日起计算。赎回费由赎回人承担, 在投资者赎回基金份额时收取, 所收取赎回费的25%归入基金资产, 其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。
(2) 为尽可能保证份额持有人享有基金份额补偿, 对于投资者在基金开放日常申购、赎回之日起1年以内申请赎回的, 赎回基金份额优先补偿在该期间之内日常申购的基金份额。投资者在基金开放日常申购、赎回之日起1年以后申请赎回的基金份额, 赎回确认时, 按照先进先出原则进行处理。
3. 转换费
基金转换的总费用包括转出基金份额的赎回费和申购补差费。
转出基金赎回费=转出份额×转出基金当日基金份额净值×转出基金赎回费率
转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值×(1-转出基金赎回费率)
转入基金申购补差费= max{(转入基金的申购费-转出基金的申购费), 0}, 即转入基金申购费减去转出基金申购费, 如为负数则取0
转入金额=转出金额-基金转换申购补差费
转入份额=转入金额/转入基金当日基金份额净值
其中:
转入基金的申购费=(转出金额-转出金额/(1+转入基金的申购费率))或转入基金固定收费金额
转出基金的申购费=(转出金额-转出金额/(1+转出基金的申购费率))或转出基金固定收费金额
转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位, 由此产生的误差计入基金资产。
注1: 本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务。
注2: 关于转换费用的其他相关条款请详见公司网站的有关临时公告。
(三) 其他费用
1. 基金财产拨划支付的银行费用;
2. 基金合同生效后的信息披露费用;
3. 基金份额持有人大会费用;
4. 基金合同生效后的会计师费和律师费;
5. 基金的证券交易费用;
6. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
上述基金费用中第1至7项费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议的规定, 按照费用实际支出金额支付, 列入当期基金费用。
(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也不从基金财产中支付。
(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和基金托管费率, 降低基金管理费率、基金托管费率, 无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须提前于新的费率实施日的3个工作日前在至少一种指定媒体上公告。
(六) 基金的税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定, 履行纳税义务。
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》、《公开募集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》及其他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, 对本基金的招募说明书进行了更新, 主要更新的内容如下:

章节	主要内容
三、基金管理人	更新了基金管理人的部分信息。
五、相关服务机构	更新了基金销售机构信息。
九、基金份额的申购与赎回	更新了单笔最低赎回份额, 单笔最低赎回转出份额和最低保留余额限制。
十一、基金的投资	更新了吸收收益投资的相关内容; 更新了本基金基金赎回投资策略相关内容。
十二、基金业绩	更新了基金合同生效以来的基金业绩。
二十三、对基金基金资产净值的复核	更新了基金电子数据与基金估值数据的第三方支付渠道, 详见招募说明书。
四、其他应披露事项	披露了自2015年10月10日至2016年4月10日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一六年五月二十五日

华安基金管理有限公司关于华安保本混合型证券投资基金参加深圳前海微众银行股份有限公司费率优惠活动的公告

为感谢广大投资者长期以来的信任与支持, 华安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经与深圳前海微众银行股份有限公司(以下简称“微众银行”)协商, 决定自2016年5月25日起, 增加华安保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”, 基金代码: 000072)参加微众银行基金申购费率优惠活动, 现将有关事项公告如下:
一、适用投资者范围
本活动适用于依据中华人民共和国有关法律法规和基金合同规定可以投资证券投资基金的个人投资者。
二、优惠活动时间
在优惠活动期间, 个人投资者通过微众银行非柜台渠道申购(定投)本基金, 申购费率按1折优惠。
三、注意事项
1. 本基金申购费不包括基金转换业务等其他业务的基金手续费。
2. 基金申购费率及详细