

(上接B051版)

法定代表人: 路磊  
电话: 010-59539718, 59539728  
传真: 010-65807110  
电话: 96162, 4008888160  
网址: [www.cifcofund.com/](http://www.cifcofund.com/)  
(11) 众升资产管理(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6号楼3201内3201单元  
办公地址: 北京市朝阳区东四环中路27号院6号楼3201内3201单元  
法定代表人: 李海博  
电话: 010-59393023  
传真: 010-59393074  
电话: 4008080069  
网址: [www.yf-fund.com/](http://www.yf-fund.com/)  
(12) 深圳众安基金股权投资股份有限公司  
注册地址: 深圳市福田区深南西路4047号发展银行大厦25楼J1单元  
办公地址: 深圳市福田区深南西路4047号发展银行大厦25楼J1单元  
法定代表人: 薛峰  
电话: 4006-788-887  
电话: 0755-82080787  
网址: [www.zlfund.com](http://www.zlfund.com), [www.jlmmw.com](http://www.jlmmw.com)  
(13) 联讯证券股份有限公司  
注册地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路65号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和二三四层  
办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路65号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和二三四层  
法定代表人: 徐刚  
客服电话: 959544  
网址: <http://www.lxsec.com>  
(14) 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18号保利广场E座18F  
法定代表人: 王利  
联系人: 吴卫东  
电话: 021-20838787  
传真: 021-20838793  
客户服务电话: 400-920-0022  
网址: <http://stock.hexun.com>  
(15) 中国银河国际期货有限公司  
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: 400-662-8888  
公司网站: [www.clicfo.com/](http://www.clicfo.com/)  
(16) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006W  
办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦A座9层  
法定代表人: 洪继  
客服电话: 400-850-7771  
公司网站: <http://tq.tj.cn/>  
(17) 北京财信基金销售有限公司  
注册地址: 北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层102号  
办公地址: 北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层102号  
法定代表人: 罗智安  
联系电话: 400-001-8811  
公司网站: <http://www.czyec.com>, [www.czyec.com.cn](http://www.czyec.com.cn)  
(18) 太平洋证券股份有限公司  
注册地址: 云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼  
办公地址: 云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼  
法定代表人: 李永华  
客服电话: 0871-68909130  
公司网站: <http://www.tpyz.com>  
(19) 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: 上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼  
法定代表人: 陈皓  
联系电话: 021-33323903  
传真号码: 021-33323903  
客户服务电话: 400-820-2819  
网址: [fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)  
(20) 泉州银行股份有限公司  
注册地址: 泉州市云霞路3号  
办公地址: 泉州市云霞路3号  
法定代表人: 傅耀雄  
联系人: 李博  
联系电话: 0595-22551071  
传真号码: 0595-22506215  
(21) 路财富(北京)信息科技有限公司  
地址: 北京市朝阳区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208  
法定代表人: 张雪涛  
客服电话: 4000011566  
网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)  
(22) 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: 李海平  
客服电话: 4008980618  
网址: [www.chtfund.com/](http://www.chtfund.com/)  
(23) 银银基金销售有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区银城中路1217号16楼01单元  
办公地址: 上海市浦东新区银城中路1217号16楼01单元  
法定代表人: 刘惠  
联系电话: 021-80133888  
传真号码: 021-80133413  
客户服务电话: 400-800-1016  
网址: <http://www.fundhaiyin.com>  
(24) 上海陆金所资产管理有限公司  
注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元  
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
法定代表人: 郭坚  
联系人: 宁博宇  
联系电话: 021-20666562  
传真号码: 021-22066651  
(25) 北京乐融多源投资管理有限公司  
地址: 北京市朝阳区东三环北路1号院1号楼16层1603  
法定代表人: 董浩  
客户服务电话: 400-068-1176  
网址: [www.jlmdfund.com](http://www.jlmdfund.com)  
(26) 深圳前海财智资产管理有限公司  
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: 深圳市南山区后海大道七道惠恒集团二期418室  
法定代表人: 李勇  
客户服务电话: 0755-82090913  
网址: [www.jinjiangw.com](http://www.jinjiangw.com)  
(27) 上海联泰资产管理有限公司  
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区277号3层310室  
办公地址: 上海市浦东新区高东一路156号18号楼4层  
法定代表人: 燕斌  
客户服务电话: 400-046-6788  
网址: [www.66zichuan.com](http://www.66zichuan.com)  
(28) 大泰金石投资管理有限公司  
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: 上海市市长宁区虹桥路1386号文博大厦15楼  
法定代表人: 袁敏明  
联系电话: 021-22267967  
传真号码: 021-22283089  
网址: [www.dtfunds.com/](http://www.dtfunds.com/)  
(29) 珠海盈米财富管理有限公司  
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号保利国际广场南塔12楼  
法定代表人: 肖雯  
联系电话: 020-89629021  
(30) 宏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: 四川成都高新区天府二街18号川信大厦10楼  
法定代表人: 吴玉明  
客服电话: 4008-366-366  
(31) 上海利得基金销售有限公司  
注册地址: 上海市虹口区吴淞路647号103室  
办公地址: 上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  
法定代表人: 沈亚楠  
联系电话: 86-021-50683533  
传真号码: 86-021-50683633  
客户服务电话: 4000676286  
网址: [www.leaderbank.com.cn](http://www.leaderbank.com.cn)  
(32) 北京君恒汇通投资管理有限公司  
注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一室1502室  
办公地址: 北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼二室2202室  
法定代表人: 李振  
联系电话: 65181028  
传真号码: 65174782  
客户服务电话: 400-066-0636  
网址: [www.kstsecurities.com](http://www.kstsecurities.com)  
(33) 中汇金丰(北京)投资管理有限公司  
地址: 北京市丰台区东大街东大街2号4-45室  
法定代表人: 彭运华  
客户服务电话: 4008909998  
网址: <http://www.plcc.com>  
(34) 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: <http://www.tlxwcf.com>  
(35) 上海凯石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: 陈维武  
客户服务电话: 4000 178 000  
网址: [www.linxianfund.com](http://www.linxianfund.com)  
(36) 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  
客户服务电话: 400-6767-523  
网址: [www.zzwelth.cn](http://www.zzwelth.cn)  
(37) 苏州银行股份有限公司  
注册地址: 江苏省苏州工业园区钟园路728号  
办公地址: 江苏省苏州工业园区钟园路728号  
法定代表人: 王兰飞  
联系电话: 0512-65280149  
传真号码: 0512-69968370  
(38) 北京铁钰财富投资管理有限公司  
注册地址: 北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层  
办公地址: 北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层  
法定代表人: 赵希春  
联系电话: 010-57418813  
传真号码: 010-57593671  
(39) 北京乾裕上信投资管理有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内0909室  
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路19号楼701内0909室  
法定代表人: 李奇军  
联系电话: 010 65983311  
传真号码: 010 65983333  
(40) 中经北证(北京)资产管理有限公司  
注册地址: 北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
办公地址: 北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
法定代表人: 徐海福  
联系电话: 010-68227475  
传真号码: 010-68292941  
(41) 丹万投资管理(北京)有限公司  
注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005号  
办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005号  
法定代表人: 韩述涛  
联系电话: 010 89085858  
传真号码: 010 89085195  
客户服务电话: 4008000562  
公司网站: [www.zwywec.com](http://www.zwywec.com)  
(42) 浙江金观诚财富管理有限公司  
注册地址: 杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室  
办公地址: 杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一幢金观诚财富中心  
法定代表人: 徐黎云  
联系电话: 0571-88337717  
传真号码: 0571-88337666  
(43) 东莞农村商业银行股份有限公司  
注册地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路2号  
办公地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路2号  
法定代表人: 何伟良  
联系电话: 0769-22862624  
传真号码: 0769-22862622  
(44) 北京展瑞天下一投资管理有限公司  
注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村738号03室  
办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号恒华中心21层  
法定代表人: 蒋希春  
联系电话: 010-5817 0800  
传真号码: 010-5817 0859  
(45) 英大证券有限责任公司(筹)  
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室、1116 室及 1300 室  
网站：[www.1300fund.com](http://www.1300fund.com)

法定代表人：TAN YIK KUAN  
联系人：叶祖强  
联系电话：0755-83946067  
传真：0755-21674453  
客户服务电话：400-684-0500

公司网站：[www.haite.com.cn](http://www.haite.com.cn)  
(146) 北京汇通泰达基金销售有限公司  
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号二层A座606室  
办公地址：北京市朝阳区京顺东四区浦项中心B座19层  
法定代表人：齐剑梅  
联系电话：4006232600  
传真：010-82026590  
(147) 中信期货有限公司  
地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座11层1301-1303室、14层  
法定代表人：张皓  
联系电话：400-990-8826  
网站：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)  
(148) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司  
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）  
办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金田大厦23A  
法定代表人：高峰  
联系电话：0755-83665588  
传真号码：0755-83665518  
(149) 深圳金斧头基金销售有限公司  
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼  
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼  
法定代表人：赖建仁  
联系电话：0755-66882301  
传真号码：0755-66882399  
(150) 江苏常熟农村商业银行股份有限公司  
地址：江苏省常熟市新世纪大道68号  
法定代表人：宋黎明  
客户服务电话：4006692000、0512-9632000或前往常熟农商银行各营业网点进行咨询  
网站：[www.csrcbank.com](http://www.csrcbank.com)  
(151) 北京壹基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区望京东路2号院2号楼2单元211室222507  
办公地址：北京市朝阳区恒通东大街1号院6号楼2单元211室11层1108  
住所：北京市朝阳区恒通东大街1号院6号楼2单元211室222507  
法定代表人：钟建雄  
客户服务电话：4006619518  
传真：010-61940693  
网站：<http://danjiafundapp.com/>  
(152) 上海大智慧财富管理有限公司  
注册地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层  
办公地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层  
法定代表人：申健  
客服电话：021-20219331  
(153) 北京金启源投资管理有限公司  
网站：<http://jgqy.com>  
注册地址：北京市西城区月坛南街31号中水大厦215A  
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A  
法定代表人：梁善  
联系电话：010-66164828  
传真号码：010-89876729  
(154) 北京汇成基金销售有限公司  
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108  
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108  
法定代表人：王恒刚  
联系电话：010-56212140  
传真号码：010-62680827  
(155) 江苏昆山农村商业银行股份有限公司  
注册地址：江苏省昆山市前进东路828号  
办公地址：江苏省昆山市前进东路828号  
法定代表人：张忻清  
联系电话：(0512) 56737980  
传真号码：(0512) 57376090  
(156) 深圳前海众合金融有限公司  
注册地址：北京市海淀区北四环西路96号906室  
办公地址：北京市海淀区海淀北二街10号泰康大厦12层  
法定代表人：张琪  
联系电话：010-62676399  
传真：010-62607516  
(157) 嘉兴银行股份有限公司  
注册地址：嘉兴市建国南路409号  
办公地址：嘉兴市建国南路409号  
法定代表人：夏林生  
联系电话：0573-96528  
传真号码：0573-82099678  
(158) 宁波银行股份有限公司  
地址：宁波市鄞州区中山东路700号  
法定代表人：陆华兴  
客户服务电话：96574  
网站：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)  
(159) 南京苏宁基金销售有限公司  
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号  
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号  
法定代表人：钱燕飞  
联系人：李坤明  
联系电话：025-66996999-884131  
传真号码：025-66996699  
联系邮箱：[1507148@csuning.com](mailto:1507148@csuning.com)  
(160) 上海万得投资顾问有限公司  
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路32号11楼B座  
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路32号39楼  
法定代表人：王廷富  
联系电话：021-51327185  
传真号码：021-68881221  
(161) 天阳财富基金销售有限公司  
注册地址：天津经济技术开发区南开区工业园区综合服务中心办公楼B座2层202-124室  
办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层  
法定代表人：王东京  
联系电话：010-69287061  
传真号码：010-69287825  
(162) 南京途牛金融信息服务有限公司  
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号  
办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号  
法定代表人：宋时琳  
联系电话：025-96853969  
传真号码：025-96853969  
(163) 和信财富基金销售有限公司  
注册地址：郑州市郑东新区东龙湖国际中心互联网金融大厦6层  
办公地址：郑州市郑东新区东龙湖国际中心互联网金融大厦6层  
法定代表人：李慧慧  
联系电话：0371-85183366  
传真：0371-85183537  
(164) 上海云湾投资管理有限公司  
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
法定代表人：戴晓峰  
联系电话：021-20538888  
传真号码：021-20538999  
(165) 乾道金融信息服务（北京）有限公司  
注册地址：北京市海淀区东北旺村1号院7楼717室  
办公地址：北京市海淀区中关村大街68号中关村创业大街3102室  
法定代表人：王兴吉  
联系电话：010-62062880  
传真号码：010-62067741  
(166) 北京徽银基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼银泰国际广场5层1119号  
办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼银泰国际广场5层1119号  
法定代表人：许现良  
联系电话：4001-598-082  
传真号码：010-57649620  
(167) 华安证券有限责任公司  
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01b）单元  
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01b）单元  
法定代表人：俞奇华  
联系电话：021-32109999  
公司网站：<http://www.cfsc.com.cn>  
(168) 东海证券有限责任公司  
注册地址：上海市浦东新区东方路 1929 号东海证券大厦 8 楼  
法定代表人：陈磊  
电话：95631/400-8888588  
网站：[www.qh168.com](http://www.qh168.com)  
(169) 上海挖财金融信息服务有限公司  
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼  
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼  
法定代表人：胡洪亮  
联系电话：021-50810687  
传真号码：021-63309870  
客户服务电话：021-50810673  
网站：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)  
(170) 济安财富（北京）资本管理有限公司  
注册地址：北京市朝阳区东三环中路39号院4号楼40层4001室  
办公地址：北京市朝阳区东三环中路39号院4号楼40层4001室  
法定代表人：杨健  
联系人：李海鑫  
电话：010-65309516  
传真：010-65309599  
客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯微信）

经 公司网站：[www.jianfutuone.com](http://www.jianfutuone.com)  
(171) 泰康财富基金销售有限公司（大连）  
法定代表人：林建宏  
地址：辽宁省大连市沙河口区星海广场4号3号  
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海广场4号3号  
电话：400-6411-180  
网站：[www.taichangwealth.com](http://www.taichangwealth.com)  
(172) 北京肯特财富投资管理有限公司  
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15  
法定代表人：陈超  
电话：4008885114/4009888616  
传 真：010-89188000  
(173) 福建海峡银行股份有限公司  
注册地址：福州市台江区江滨中大道368号福建海峡银行  
办公地址：福州市台江区江滨中大道368号福建海峡银行  
法定代表人：李善斌  
传真号码：0591-87330926  
(174) 上海明煜大统基金销售有限公司  
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼  
法定代表人：廖康  
联系电话：021-80234888  
传真号码：021-80234898  
(175) 贵州贵和安汇基金销售有限公司  
注册地址：贵州省黔南布依族苗族自治州丹寨县经济开发区标准厂房  
办公地址：贵州省贵阳市云岩区北京路9号贵州医科大学学术交流中心16楼  
法定代表人：李陆军  
联系电话：(0851) 89369699  
传真：(0851) 89369690  
(176) 上海华夏财富投资管理有限公司  
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室  
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层  
法定代表人：李一梅  
联系人：任秋明  
电话：010-88066632  
传真：010-88066562  
客户服务电话：400-817-7666  
网站：[www.amcfund.com](http://www.amcfund.com)  
(177) 上海通华财富资产管理有限公司  
注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室  
办公地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室  
法定代表人：兰奇  
客户服务电话：021-61766900  
网站：[www.tonghuafund.cn](http://www.tonghuafund.cn)  
(二) 基金注册登记机构  
名称：华夏基金管理有限公司  
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期31-32层  
法定代表人：宋光华  
电话：(021) 33869999  
传真：(021) 33837662  
联系人：袁静  
客户服务电话：40088-50099  
(三) 律师事务所和经办律师  
名称：通力律师事务所  
注册地址：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) 31358666  
传真：(021) 31358600  
经办律师：韩炯、秦源明  
(四) 会计师事务所和审计会计师事务所  
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国上海市浦东新区浦三路202号企业天地2号楼永业道中心11楼  
办公地址：中国上海市黄浦区湖陆路2号企业天地2号楼永业道中心11楼  
首席执行官：李丹  
联系电话：(021) 123238888  
联系传真：(021) 123238800  
联系人：张俊波  
经办会计师：李峰、张振波

六、基金名称  
本基金名称：华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

七、基金类型  
本基金类型：股票型开放式

八、基金的投资目标  
运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对MSCI中国A股指数的有限跟踪误差，为本基金投资者追求超越基准基金长期增值，并谋求基金资产长期增值的长期目标，并实现一定的收益分配。

九、基金的投资方向  
本基金资产主要投资于标的指数成份股。具体的投资范围为：  
(1) 股票投资组合：本基金投资于股票的目标比例不低于基金资产净值的90%。本基金主要投资于二级市场流动性较好的股票，可以根据开放式基金运作的实际需求对市场中的实际情况，适当调整基金资产配置比例。  
(2) 股票资产配置：本基金以MSCI中国A股指数成份股构成权重成份股等权重为基准，通过复制和有限度的增强投资方法，构造跟踪投资组合。在投资组合建立后，基金管理人将根据跟踪误差与组合权重调整策略，适时对投资组合进行动态调整，使跟踪误差控制在规定的范围内。此外，本基金还将参与一级市场的新股申购、股票增发等。  
(3) 其他投资类别：本基金将投资于经中国证监会批准的其他金融工具，减少本基金资产的风险并提高基金收益。  
(4) 股指期货投资  
1) 股票指数期货合约选择构建：  
本基金将使用股指期货合约来实现对MSCI中国A股指数的跟踪，其过程如下：  
①以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重为基础构建标准权重的指数化投资组合；  
②根据跟踪误差选择标准，对标准权重的指数化投资组合进行调整，形成跟踪误差最小的投资组合；  
③根据对跟踪误差的模型化分析，通过股指期货投资组合交易系统运行买卖；  
(5) 基金合理运用股指期货过程中的买卖情况、申购赎回情况等，对投资组合进行动态调整，以保证对股票投资组合的构建。

十、基金的投资策略  
(一) 增强性投资选择标准  
本基金增强性投资，是指基于研究员和基金经理对于上市公司及上市公司所在行业研究和判断的基础上，由基金经理根据股票市场的具体情况，对投资组合中的股票仓位、行业配置、个股权重进行适当调整。对于以下成份股，本基金将考虑予以除权重或权重平均水平的个股：  
①由于公司经营状况、财务状况严重恶化或者其他基本面发生重大变化而导致其投资价值严重下降的个股；  
②因流动性太差而无法按照标准权重买入建仓的个股；  
③存在重大违法违规，被监管部门调查的个股；  
④基金管理人充分调研的基础上，判断预期收益将远低于成份股中同类股票或指数权重平均水平的个股；  
⑤对于其他个股，例如预期将纳入指数的个股等。  
对于以下个股，本基金将考虑从组合中增加权重：  
①新股发售而得到的非流通股及因增发融资而超出指数标准权重的成份股；  
②由于其他成份股的停牌而被选择作为替代的个股；  
③基金管理人充分调研的基础上，判断预期收益将远高于成份股中同类股票或指数权重平均水平的个股；  
④其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股等。  
(二) 指数化投资组合投资方法  
本基金指数化投资方法，是指以跟踪误差为基准，为控制跟踪误差而导致的股票资产相对指数标准权重偏差，本基金将对于跟踪误差最大容忍度设定为30.5%，如该指标接近或超过20.5%，（相应标的年跟踪误差率约为7.75%），则基金管理人必须执行跟踪分析，找出造成跟踪误差的主要原因，如来源于股票回购的最大容忍度，以及其他成份股停牌、行业、个股和整体投资组合相对指数的偏差度，以及对新股发售等一级市场投资行为的影响，基金管理人将据此会测算并调整替代代表跟踪误差的周期跟踪误差，具体变化将另行公告。

除上述之外，本基金对增强性投资的其他限制包括：  
①在本基金成立之日起的合理期间后，投资组合中持有的MSCI中国A股指数成份股的权重不低于指数成份股的权重50%；  
②在本基金成立之日起的合理期间后，投资组合中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的70%。

二、投资管理程序  
(一) 投资决策程序  
1) 投资决策委员会定期召开会议，对阶段性的投资组合资产配置比例和行业权重进行审议并同意下一阶段的投资计划；  
2) 金融工程小组利用集市场场模型和风险控制模型对行业、个股和市场的预期收益进行测算，研究部门对基金管理人管理的其他基金持有股票的市场预期收益，开放式基金总部提供申购、赎回的流动性数据，供基金经理参考；  
3) 基金管理人根据模型上反馈的预测，初步决定投资组合，包括股票、现金以及其他成份股的投资比例，行业、个股和整体投资组合相对指数的偏差度，以及对新股发售等一级市场投资行为的影响，基金管理人将据此会测算并调整替代代表跟踪误差的周期跟踪误差，具体变化将另行公告。

三、风险控制程序  
(一) 基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二) 风险控制程序  
1) 风险控制程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(七) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(八) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(九) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十一) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十二) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十五) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十六) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十七) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十八) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(十九) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十一) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十二) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十五) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十六) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十七) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十八) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(二十九) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十一) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十二) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十五) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十六) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十七) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十八) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(三十九) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十一) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十二) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十五) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十六) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十七) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十八) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(四十九) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十一) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十二) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十五) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十六) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十七) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十八) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(五十九) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六十) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六十一) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六十二) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六十三) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六十四) 风险监控程序  
1) 风险监控程序：基金管理人提供投资组合的反馈数据，对组合进行适度调整，对于调整后的个股，研究部门需提供投资组合的反馈数据；  
(六十五) 风险监控程序  
1)

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	600610	华资实业	134,043	11,788,863.48	2.34
2	002008	大康牧业	1,947,338	48,529,569.26	21.14
3	000585	五粮液	1,036,832	47,120,776.00	2.03
4	600818	中南证券	1,211,975	44,165,179.65	2.04
5	000921	锦兴能源	1,309,722	41,818,107.40	1.79
6	002028	宝胜股份	819,214	40,633,014.40	1.76
7	600060	通商银行	2,066,392	33,066,925.92	1.43
8	600276	恒顺股份	606,418	32,946,689.94	1.42
9	601818	光大银行	6,576,322	29,197,663.42	1.17
10	000937	冀东能源	3,716,434	24,900,107.80	1.08

3.2 报告期末积极投资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	600093	马应龙	1,761,828	38,466,281.56	1.67
2	300144	宋城演艺	1,444,629	29,197,260.68	1.22
3	603886	好莱客	707,547	29,007,667.32	1.12
4	300207	华信新材	1,667,145	20,844,212.50	0.90
5	000603	盛达股份	996,431	16,628,266.70	0.67

4 报告期末未投资品种分类的债券投资投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业中期票据	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(可交换债)	7,038,003.26	0.30
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	7,038,003.26	0.30

5 报告期末未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	113011	113011	49,750	9,975,000.00	0.21
2	110031	110031	8,920	923,220.00	0.04
3	110036	110036	3,370	433,584.20	0.02
4	128013	128013	4,124	427,988.72	0.02
5	128009	128009	2,151	276,210.34	0.01

6 报告期末未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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末未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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末未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

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末未公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

元。

10 报告期末未本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

元。

10.2 报告期末未本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

元

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内,本基金投资的前十名被投资主体的行业主体没有被监管部门立案调查的,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 本基金投资前十名股票中,不存在投资于基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	963,401.94
2	应收证券清算款	6,567,411.88
3	应收利息	--
4	应收股利	--
5	其他应收款	29,440.40
6	其他流动资产	1,820,243.96
7	预付款项	--
8	其他	--
9	合计	9,380,598.18

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	金轮转债	276,210.34	0.01
2	128013	洪涛转债	427,988.72	0.02
3	110036	白云转债	433,584.20	0.02
4	110031	弘信转债	923,220.00	0.04

11.5 报告期末未投资的股票存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末未投资的股票前十名股票存在流通受限情况的说明

未持有报告期末未投资股票前十名股票不存在流通受限情况

11.5.2 报告期末未投资的股票前五名股票存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票不存在流通受限情况。

十四、基金的业绩

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预示其未来表现。投资者在投资前,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际历史净值增长率等指标,与同期比较基准基准收益率比较

(截止时点2016年12月31日)

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2016-1-1至2016-12-31	-10.16%	1.55%	-13.97%	1.45%	3.81%	2.36%
2015-1-1至2015-12-31	10.07%	2.57%	10.26%	2.37%	-0.10%	0.20%
2014-1-1至2014-12-31	40.98%	1.13%	44.53%	1.10%	4.46%	0.03%
2013-1-1至2013-12-31	-4.06%	1.31%	-3.02%	1.20%	-0.24%	0.02%
2012-1-1至2012-12-31	8.34%	1.26%	6.29%	1.23%	2.05%	0.03%
2011-1-1至2011-12-31	-26.64%	1.25%	-26.76%	1.25%	0.12%	0.00%
2010-1-1至2010-12-31	-6.65%	1.49%	-8.13%	1.49%	1.53%	0.00%
2009-1-1至2009-12-31	85.11%	1.37%	90.27%	1.52%	-5.16%	-0.05%
2008-1-1至2008-12-31	-82.45%	2.81%	-81.41%	2.86%	-1.04%	0.05%
2007-1-1至2007-12-31	154.07%	2.15%	148.39%	2.17%	5.68%	-0.02%
2006-1-1至2006-12-31	121.21%	1.29%	116.27%	1.32%	4.94%	-0.03%
2005-1-1至2005-12-31	-0.65%	1.08%	-1.80%	1.13%	1.24%	0.05%
2004-1-1至2004-12-31	-8.90%	1.02%	-13.41%	1.00%	4.51%	0.02%
2003-1-1至2003-12-31	11.46%	0.85%	6.17%	0.86%	3.29%	-0.01%
2002-1-1至2002-12-31	-1.70%	0.23%	-8.76%	0.02%	7.06%	-0.69%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十五、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1. 基金费用的种类

(1)基金管理人管理费

基金管理人管理费=前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$
$$H = \text{每日应计提的基金管理人费}$$
$$E = \text{前一日基金资产净值}$$

基金管理人管理费按日计提,逐日累计至每个月月末,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,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2)基金托管人托管费

基金托管人托管费=前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$
$$H = \text{每日应计提的基金托管费}$$
$$E = \text{前一日基金资产净值}$$

基金托管人托管费按日计提,逐日累计至每个月月末,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,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(3)证券交易费用

(4)基金信息披露费用

(5)基金销售服务费用及大会费用

(6)与基金相关的会计师事务所费

(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用

上述基金费用中第(3)至(7)项费用由基金托管人根据其有关法律法规和相应协议的约定,按费用实际支出金额列入当期基金费用。

2. 不列入基金费用的项目

基金管理人及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资产损失,基金管理人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。

3. 费用调整

基金管理人及基金托管人可磋商调低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金持有人大会决议通过。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金提供两种申购费的支付方式。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费。申购者可选择前端的或后端的申购费。

(1)前端收费模式的申购费按申购金额采用下列费率

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

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,企业年金单一计划以及组合计划,如将来出现经国务院基金监管部门认可的新的养老养老类型,基金管理人将在招募说明书更新时或追加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之外的其他投资者。

通过基金管理人直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

其他投资者申购本基金基金份额申购费率按下表(直销机构、电子交易平台除外):

申购金额	单笔申购费	申购费率
前100万	30元<=M<100万	申购费1000元
100万<M<1000万	M*0.1%	1.20%
M>1000万	M*0.07%	1.05%

(2)后端收费模式的申购费按持有时间递减,申购费率如下:

收费模式	持有期限(自申购日至赎回日)	申购费率
后端申购费	Y<1年	1.50%
	1年<=Y<2年	1.30%
	2年<=Y<3年	1.20%
	3年<=Y<5年	1.00%
	Y>=5年	0

注:1年指365天,2年指730天,依此类推。

主要基于申购的投资者承担了并跟踪投资人的选择在申购或赎回基金份额时收取,主要用于本基金的日常推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费

本基金的赎回费用统一为0,投资者赎回申请的确认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的销售费和申购补差费。

转出基金赎回费=转出份额\*转出基金当日基金份额净值\*转出基金份额赎回费率

转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值-转出基金份额回费  
基金转换申购补差费按转入与转出基金之间申购费的差额计取收取，具体计算公式如下：  
 $\text{基金转换申购补差费} = \max\{\text{（转入基金的申购费}-\text{转出基金的申购费）}, 0\}$   
即基金转换申购补差费去基金申购费，如为负数则取0  
转出金额=转出金额-基金转换申购费  
转入金额=转入金额+基金转换当日基金份额净值  
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)  
或出基金固定收费金额  
注1：转入的认购的计算结果四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差记入基金资产。  
注2：本基金暂未开通后端收费模式下的基金转换业务。  
注3：关于转换费用的其它相关条款请详见公司网站的有关临时公告。  
(三)其他费用  
(1) 证券交易费用  
(2) 基金信息披露费用  
(3) 基金持有人持有大会费用  
(4) 与基金相关的会计费用和律师费用  
(5) 按照国家有关规定可以列入的其他费用  
上述基金费用由基金管理人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，从费用支出中支付或由基金托管人于当期基金估值日计提。  
(四) 未计入基金费用的项目  
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资产损失，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。  
(五) 费用调整  
当法律法规发生变化，或在合同约定的范围内变更基金管理费和基金托管费，此项调不需要基金会议的持有人大会决议通过。  
(六) 基金的税收  
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家相关法律法规执行。  
十六、对招募说明书更新部分说明  
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销售管理办法》、《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》及基金相关的法规和监管部门的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原始招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

修订	主要内容
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人相关信息。
九、基金服务机构	更新了基金服务机构的信息。
九、基金的投资	更新了基金的投资范围、投资策略和投资组合的内部。
十、基金的业绩	更新了基金自成立以来的投资业绩。
二十一、对基金估值和净值服务	修改了估值方法和估值程序；删除了“(六) 电子直销交易系统”；(七) 增加了“基金估值”、“基金净值”；(八) 增加了基金估值和基金净值的计算方法。
二十二、其他应披露事项	披露了[2016年]月[ ]日至[2017年]月[ ]日期间内的基金公告信息。

华安基金管理有限公司  
二〇一七年六月二十二日

## 华安基金管理有限公司

# 关于华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第6期收益支付公告

公发出送日期:2017年6月22日

### 1.公告基本信息

基金名称	华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金
基金简称	华安月安鑫
基金代码	040033
基金合同生效日	2012年07月11日
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》及《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》及《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同生效公告》
收益支付日期	2017年6月20日
收益支付时间	2017年6月19日至2017年6月20日止

### 2. 与收益支付相关的其他信息

累计收益计算方式	投资者累计赎回-累计赎回金额(扣除投资者日收益净值累加); 投资者日收益=投资者当日持有的基金份额×投资者选择红利再投资方式(保留两位小数); 投资者选择红利再投资方式(保留两位小数);
可供支付的基金余额可取赎回日	2017年7月1日
收益支付对象	2017年6月19日在华安基金管理有限公司登记在册的本基金持有人
收益支付方式	本基金收益支付方式分为现金支付、现金分红和股票支付。2017年6月19日从托管银行划出;投资者选择红利再投资方式的,2017年6月22日起开始支付。
股利扣事项的说明	根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》及财税[2008]3号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂免征收个人所得税。
股利扣事项的说明	本基金在每次收益分配时优先向红利再投资投资者支付。

### 3.其他需要提示的事项

(1) 华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第6期已于2017年6月10日结束本期运作,共运作期限33天,该运作期间基金A类份额(基金代码:040033)年化收益率17.5367%,基金B类份额(基金代码:040034)的年化收益率为0.00%。

(2) 投资者于2017年6月16日、6月16日和6月19日集中申购的基金份额不享有当期收益,于2017年6月19日赎回的基金份额享有当期收益。

(3) 若投资者于2017年6月19日全赎回全部基金份额,本基金将累计其累计收益,并以现金形式支付。

(4) 本公告仅对本公司2017年第6期的收益支付的相关事项进行说明,投资者欲了解详细情况请参见刊登在2017年6月12日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第6期收益支付公告》及2017年6月19日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金2017年第6期收益支付公告》。

(5) 截至2017年6月20日被冻结的基金份额应分得的现金红利按现金红利再投资方式支付。

(6) 基金份额持有人可以选择现金红利,也可以选择将其所获红利再投资于本基金,如果基金份额持有人未选择本基金货币单位方式,默认为现金方式。基金份额持有人对于A类和B类基金份额分别选择不同的支付方式。选择采取红利再投资形式的,同一类基金份额的现金红利资金将按照计划划出该类别的基金份额净值再作相应的另一类别基金份额。

(7) 投资者可以在每个基金工作日的一定时间内登录系统查询网点和更改分红方式,也可以通过华安基金管理有限公司网站或交易系统进行基金收益分支。如投资者在后一个基金工作日选择的支付方式不同,将按照投资者在2017年6月20日20:00(含该日)最后一次选择的支付方式为准。

(8) 如有其它疑问,请拨打本公司客户服务热线40088-50099或登陆本公司网站([www.huanan.com.cn](http://www.huanan.com.cn))获取相关信息。

风险提示:  
本基金管理人承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。本公司的收益支付情况及其他相关信息不构成对其后基金运作期间实际收益的承诺或保证。

特此公告。  
华安基金管理有限公司  
2017年6月22日

## 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中原银行股份有限公司为销售机构的公告

根据华安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)和中原银行股份有限公司(以下简称“中原银行”)签署的销售协议,自2017年6月23日起,上述销售机构开始销售华安基金。投资者可在下述基金的申购赎回时向中原银行办理基金申购等业务。具体的业务流程、办理时间和办理方式以中原银行的规定为准。

基金代码	基金名称
040027	华安月月宝
040028	华安月月宝
040029	华安月月宝
040032	华安月月宝(存)
040033	华安月月宝
040034	华安月月宝
040037	华安月月宝(存)

### 咨询办法

1.中原银行股份有限公司  
客户服务电话:96888  
网址:[www.zybank.com.cn](http://www.zybank.com.cn)

2.华安基金管理有限公司  
客户服务电话:40088-50099  
网址:[www.huanan.com.cn](http://www.huanan.com.cn)  
特此公告

华安基金管理有限公司  
二〇一七年六月二十二日

## 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份有限公司为销售机构的公告

根据华安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)和财通证券股份有限公司(以下简称“财通证券”)签署的销售协议,自2017年6月23日起,上述销售机构开始销售华安基金。投资者可在下述基金的申购赎回时向财通证券办理基金申购等业务。具体的业务流程、办理时间和办理方式以财通证券的规定为准。

基金代码	基金名称
013002	华安货币债
040026	华安货币债
002408	华安货币债
002381	华安货币债
040036	华安货币债

### 咨询办法

1.财通证券股份有限公司  
客户服务电话:400-869-6336  
网址:[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

2.华安基金管理有限公司  
客户服务电话:40088-50099  
网址:[www.huanan.com.cn](http://www.huanan.com.cn)  
特此公告

华安基金管理有限公司  
二〇一七年六月二十二日

## 关于上海云湾投资管理有限公司开通华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务的公告

为贯彻落实大资管长期以来的信任与支持,满足投资者的理财需求,提供便捷灵活的理财服务,华安基金管理有限公司与上海云湾投资管理有限公司(以下简称“云湾投资”)签署,决定自2017年6月23日起,华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金(约定赎回代码:040042)开通在上海云湾投资的“约定赎回”业务。“约定赎回”相关业务规则详见本公司于2013年12月21日披露的《关于华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金“约定赎回”业务并修改基金合同的公告》。

详情请咨询:  
1.上海云湾投资管理有限公司  
客服电话:4008201515  
网址:[zhongtongfunds.com](http://zhongtongfunds.com)

2.华安基金管理有限公司  
客户服务电话:40088-50099  
网址:[www.huanan.com.cn](http://www.huanan.com.cn)  
特此公告

华安基金管理有限公司  
二〇一七年六月二十二日