國出:www.zszg.com.cn

(89)红塔证券股份有限公司

法定代表人, 况雨林

电话:(0871)3577930

传直:(0871)3578827

法定代表人:孔佑杰

电话:0471-6292587

客户服务电话:无

传真:0471-6292477?

网址:www.rxzq.com.cn

(91)汀海证券有限公司

法定代表人:孙名扬

电话:(0451)82336863

传真:(0451)82287211

法定代表人: 冉云

网址: www.gjzd

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.cnhbstock.com

电话:(028)86690125

传直: (028)86690126

客户服务电话:4006-600109

(93)华宝证券有限责任公司

客户服务电话:40066-62288

网址:www.jhzq.com.cn

(92)国金证券股份有限公司

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

(90)日信证券有限责任公司

客户服务电话:(0871)63577930

注册抽址,云南省昆明市业宣路155号附1号

注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号

办公地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

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

办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼

```
信息披露 Disclosure
(上接B037版)
                                                     (94)厦门证券有限公司
                                                      注册地址: 厦门市莲前西路2 号莲富大厦十七楼
  办公地址: 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
                                                     办公地址:厦门市莲前西路2号莲宫大厦十七楼
  法定代表人:朱科敏
  电话:021-20333333
                                                     电话:0592-5161642
                                                      传真:0592-5161140
  客户服务电话:4008888588
                                                      客户服务电话:0592-5163588
  网址: www.longone.com.cn
                                                     网址:www.xmzq.com.cn
  (73)中银国际证券有限责任公司
                                                     (95)爱建证券有限责任公司
   注册地址:中国上海浦东银城中路200号中银大厦39层
                                                     注册地址:上海市世纪大道1600号32楼
  办公地址:中国上海浦东银城中路200号中银大厦39、40、41层
                                                      办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
   法定代表人:钱卫
                                                     法定代表人:钱华
  电话: (021)68604866
                                                      电话:(021)3222988
  传真:(021)58883554
                                                     传真:(021)62878701
  客户服务电话:021-4006208888
网址:www.bocichina.com
                                                      客户服务电话:4001962502
                                                     Mth.www.aiza.com/common/index.isn
  (74)恒泰证券股份有限公司
                                                      (96)英大证券有限责任公司
  注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行
                                                     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、三十一层
办公楼14-18楼
  办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行
                                                     法定代表人:吴骏
办公楼14-18楼
                                                      电话:(0755)83007041 83007166
  法定代表人: 庞介民
                                                     传真:(0755)83007034
  电话:(0471)4913998
                                                      客户服务电话:0755-269829
  传直:(0471)4930707
                                                     网址:www.ydsc.com.cn
(97)华融证券股份有限公司
   客户服务电话:(0471)4961259
  网封::www.cnht.com.d
                                                      注册地址:北京市西城区金融大街8号
  (75)国盛证券有限责任公司
                                                     办公地址:北京市西城区金融大街8号
  注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
                                                      法定代表人:祝献忠
  办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
                                                     电话:(010)58568007
  法定代表人:曾小普
                                                      传真:(010)58568062
  电话:(0791)6289771
                                                      客户服务电话:58568118
  传真:(0791)6289395
                                                      网址:www.hrsec.com.cn
  客户服务电话:4008222111
                                                     (98)财达证券有限责任公司
  网址:www.gsstock.com
                                                     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
  (76)申万宏源西部证券有限公司
                                                      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
  注册地址:新疆乌市鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20
                                                      法定代表人:翟建强
                                                      电话:0311-86028442
  办公地址:北京西城区太桥大街19号
                                                     传真:0311-66006244
  法定代表人: 李季
                                                      客户服务电话:4006128888
   联系电话:(010)88085858
                                                     网址:www.s10000.com
  传真号码:(010)88085198
                                                      (99)天风证券股份有限公司
  客户服务电话: 0991-400-800-0562
                                                     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
   公司网址: www.swhv
                                                      办公地址:武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座37楼
  (77)齐鲁证券有限公司
                                                     法定代表人:余磊
  注册地址:山东省济南市经七路86号
  办公地址:山东省济南市经七路86号
                                                     传真:027-87618863
  法定代表人:李玮
传真:(0531)68889752
                                                      客户服务电话: 028-86712334
                                                     网址:www.tfzq.com
(100)中天证券有限责任公司
  客户服务电话:95538
  网址: www.glzg.com.cr
                                                     注册地址: 沈阳市和平区光荣街23 号甲
    8)世纪证券有限责任公司
                                                     办公地址:沈阳市和平区光荣街23 号甲
  注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
                                                      法定代表人: 马功勋
   办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
                                                     电话:(024)23266917
  法定代表人:姜昧军
                                                     传真:(024)23255606
   电话:(0755)83199511
                                                      客户服务由话:4006180315
  传真:(0755)83199545
  客户服务电话: 400 832 3000
                                                     (101)大通证券股份有限公司
   公司网站:www.csco.co
                                                      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
  (79)第一创业证券有限责任公司
                                                   厦38、39层
  注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
                                                     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: 刘学民
                                                     法定代表人:李红光
  电话:0755-25832583
                                                     电话:0411-39673301
传真:0411-39673219
  传真:0755-25831718
  客户服务电话:4008881888
                                                      客户服务电话:4008-169-169
   网址:www.firstcapital.com.cr
                                                     网址: www.estock.com.cn
  (80)中航证券有限公司
                                                      102)天相投资顾问有限公司
   注册地址:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
                                                     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: 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A
                                                      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
  法定代表人:王宜四
                                                      电话:(010)66045608
  电话:(0791)6768763
                                                     传真:(010)66045500
  传直:(0791)6789414
                                                      客户服务电话:(010)66045678
  客户服务电话:4008866567
                                                     岡址: www.txsec.com或iiin.txsec
  网址:www.avicsec.com
(81)德邦证券有限责任公司
                                                     (103)上海华信证券有限责任公司
                                                     注册地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球会融中心90楼
   注册地址:上海市曹杨路510号南半幢9楼
                                                     办公地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼
  办公地址:上海市浦东新区福山路500号"城建国际中心"26楼
                                                      法定代表人:杨锐敏
   法定代表人:姚文平
                                                      电话:021-38784818
  电话:(021)68761616
                                                     传真:021-68775878
客户服务电话:021-38784818网址:http://www.shhxzq.com
   传真:(021)68767981
  客户服务电话:4008888128
                                                     (104)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
   网址:www.tebon.com.cn
  (82)西部证券股份有限公司
                                                      办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
  注册地址:西安市东新街232号信托大厦16—17层
                                                     法定代表人: 沈继宁
  办公地址:西安市东新街232号信托大厦16-17层
                                                      客户服务电话:0571-96336
  法定代表人:刘建武
                                                     网址: www.ctsec.com
  电话:(029)87406172
                                                     (105)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
  客户服务电话:95582
                                                     注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
  网址:www.westsecu.com.cn
                                                     办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋 2楼
  (83)华福证券有限责任公司
                                                     法定代表人:汪静波
电话:021-38600676
   注册地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
  办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
                                                     传真: 021-38509777
   法定代表人: 黄金琳
                                                     客户服务电话:400-821-5399
  电话: (0591)87383623
                                                     网址: www.noah-fund.com
(106)上海天天基金销售有限公司
  传真:(0591)87383610
  客户服务电话:(0591)96326
                                                      注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
  网址: www.hfzq.com.cn
                                                     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
  (84)华龙证券有限责任公司
                                                      法定代表人:其实
  注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
                                                     电话:400-181-8188
  办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
                                                     网址:www.1234567.com.cn
  法定代表人:李晓安
                                                     (107) 上海好买基金销售有限公司
   由话:(0931)4890100
                                                      注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
  传真:(0931)4890118
                                                      办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号903~906室
   客户服务申话:(0931)4890619
                                                      法定代表人:杨文斌
  网址:www.hlzqgs.com
                                                      客户服务电话:400-700-9665
  (85)中国国际金融股份有限公司
                                                      电话:400-700-9665
  注册批址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
   办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座6层、26层、27层及28层
                                                     网址:www.ehowbuy.com
  法定代表人:丁学东
                                                      108)杭州数米基金销售有限公司
   电话:(010)65051166
                                                     注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
  传真:(010)65051156
                                                      か公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
  客户服务电话:(010)65051166
                                                     法定代表人, 陈柏吉
  网址: www.cicc.com.cr
  (86)瑞银证券有限责任公司
                                                     國址 www.fund123.cm
  注册地址:北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
                                                     (109)上海长量基金销售投资顾问有限公司
  办公地址:北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
                                                     注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室
   法定代表人:程宜荪
                                                      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
  电话:(010)59226788
                                                      注完代表人, 张跃佳
   传真:(010)59226799
                                                      电话:021-58788678
  客户服务电话:400-887-8827
                                                     传真:021-58787698
                                                     网址: www.e-rich.com.cr
  (87)中国中投证券有限责任公司
                                                      110)浙江同花顺基金销售有限公司
  注册协划:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
                                                     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:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层
                                                      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:胡长生(代)
                                                     法定代表人:易峥
  电话:(0755)82023442
                                                      包括:0571-88920897
  传真:(0755)82026539
                                                     传直:0571-86800423
  客户服务电话:400-600-8008
                                                      客户服务电话:4008-773-772
  网址:www.china-invs.cn
                                                      公司网站: www.5ifund.com
   (88)中山证券有限责任公司
                                                     (111)北京展恒基金销售有限公司
  注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
                                                     注册协协,北京市顺义区后沙峪镇安宫街6号
   办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
                                                     办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
  法定代表人:黄扬录
                                                      法定代表人, 闫振杰
   电话:(0755)8294375
                                                      客服电话:400-888-6661
  传真:(0755)82940511
                                                      传真:(+86-10)62020088-8802
   客户服务电话:400102201
                                                     网址:www.myfp.cn
```

112)中期资产管理有限公司

话:010-59539718、59539

客服电话: 95162,4008888160

(113)万银财富(北京)基金销售有限公司

网址: www.cifcofund.co

法定代表人:路瑶

传真:010-65807110

法定代表人: 李招弟

电话:010-59393923

传真:010-59393074

客服电话:4008080069

客服电话:4006788887

而一旱大堂和三、四层

面一层大堂和三,四层

法定代表人:徐刚

客服电话:95564

法定代表人: 王莉

电话: 021-20835787

网址: licaike.hexun.c

传直:021-20835879

网址:www.Lxzq.com.ca

116)和讯信息科技有限公司

客户服务电话:400-920-0022

(117)中国国际期货有限公司

(115)联讯证券股份有限公司

(114)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址: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

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

注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

生册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西

办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西

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:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

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

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

网址:www.jjmmw.com ,www.zlfund.cn

办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大观A座3201

	法定代表人: 王兵
	客服电话: 95162
	网址: www.cifco.net
	(118)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9层
	法定代表人:陈操
	电话:(010)58325395
	传真:(010)58325282
	联系人:刘宝文
	客户服务电话:400-850-7771
	网址:https://t.jrj.com/
	(119)北京增财基金销售有限公司
	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:010-67000988
	传真号码:010-67000988-6000
	客户服务电话: 400-001-8811
	网址: http://www.zcvc.com.cn
	(120)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:梁越
	客服电话:4008980618
	网址:www.chtfund.com/
	(121)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:吴雪秀
	客服电话:4000011566
	网址:www.yilucaifu.com
	(122)海银基金销售有限公司
	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:021-80133888
	传真号码:021-80133413
	客户服务电话: 400-808-1016
	A Mussel
	(123)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:张皛
	联系电话:021-33323998
	传真号码:021-33323993
	客户服务电话: 400-820-2819
	网址: fund.bundtrade.com
	(124)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:0871-68898130
	网址:http://www.tpyzq.com
	(125)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:傅子能
	联系电话:0595-22551071
<	传真号码:0595-22505215
`	(二)基金注册与过户登记人
ζ.	名称: 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8号,上海国金中心二期31、32楼
	法定代表人:朱学华
	电话: (021)38969999
	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
	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
	联系人:秦悦民
	经办律师:韩炯、秦悦民
	(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:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼
	首席合伙人:杨绍信
	联系电话: (021)23238888
	传真: (021)23238800
	联系人:周祎
	经办会计师:汪棣、周祎
	六、基金的名称
	本基金名称:华安宝利配置证券投资基金。
	七、基金的类型
	本基金类型:契约型开放式。
	八、基金的投资目标
	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的
	and the first part when the subtraction of the subt

F,开似栖开瓜: 下表:	八 基 宏 的 中 购	和赎回情况,保	留适当比例的	
投资品种	目标比例	最高比例	最低比例	备注
可转换债券及 其对应的基础 股票	45%	70%	10%	可转换债券所 对应的基础股 票的投资比例 不超过基金净 资产的20%
其它债券(除 可转换债券 外)	30%	65%	10%	
其它股票(除 可转换债券所 对应的基础股 票外)	20%	65%	10%	

会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础

九、基金的投资方向

基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资 组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会 以实现基金的投资目标。 1、整体投资组合策略

(1)资产配置策略

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种数量模型工具,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,积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会,以 确定基金资产的分配比例,如股票市场、债券市场和短期资金市场的资产配置比 例;可转换债券在债券投资中的配置比例;债券投资中的市场配置比例;股票和可 转换债投资中的行业配置比例等。 同时基金管理人将根据预先的研究和判断,对不同的证券子市场和金融工具

设定收益目标,主动实现投资收益。 (2) 资产调控策略

基金管理人将在深入分析和研究基础上,通过适时的债券回购和逆回购操作,提高 基金资产的使用效率。此外,在获得有关监管机关的同意或许可后,本基金也将充分利用开放式回购等资产调控工具,在严格的风险管理基础上,以获得更多的投资 收益,实现在市场上升和下跌时都可能为投资人获取收益的目标。如在市场价格处 于上升过程中,本基金可以通过开放式回购交易等资产调控产品达到融资的效果; 在市场价格处于下降过程中,本基金可以通过开放式回购交易等资产调控工具达 到为投资人获取收益的效果:在市场价格不确定时,本基金可通过开放式逆回购等 资产调控工具,将融入的固定收益类证券与现券进行对冲,实现套期保值,锁定收 益:在市场资金紧张,短,长期回购成本倒置时,本基金可以通过回购利率组合进行 本基金采用资产调控策略的资金余额不得超过基金净资产的40%,若未来有

关监管机构有新规定的,按照有关监管机构的规定执行。

2. 具体品种投资策略

(1)可转换债券及其对应的基础股票的投资策略

可转换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性,结合了股票的长期增长潜 力和债券的相对安全、收益固定的优势,并有利于从资产整体配置上分散利率风险 并提高收益水平。本基金将重点从可转换债券的内在债券价值(如票面利息、利息 补偿及无条件回售价格)、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地 和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究,在公司自行开发的可转债定价分析 系统的支持下,充分发掘投资价值,并积极寻找各种套利机会,以获取更高的投资

具体的投资方法包括但不限于:新券申购以获取一、二级市场的无风险收益;

根据可转债的转股溢折价率,结合转债条款、股票基本面和流通性,确定可转债与 其对应股票之间的配置比例, 并利用转股期内基础股票转换价格与转债价格的定 价偏差进行套利;当股市良好时,持有可转换债券或逢高卖出,以享受股市上升的 利益:股市低洣时,持有可转换债券获取固定利息。

可转换债券及其对应的基础股票是本基金重要的投资品种

(2) 国债、企业债等其它固定收益类证券的投资策略 利率预期调整方法为本基金进行国债、企业债等其它固定收益类证券投资的

核心策略。基金管理人将通过利率预期调整方法,确定整体投资组合。 在利率预期调整方法的基础上,基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险 和风险溢价等因素的综合评估,合理介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。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品 种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益 类证券组合,在一定的风险度下能提供最大的预期收益,或者在确定收益率上承担

(3)其它股票的投资策略 本基金除了投资可转换债券所对应的基础股票外,还将通过基本面研究和数 量分析相结合的方法,在公司开发的条件特征选股模型的支持下,选择具有良好投

股票选择的过程如下:首先通过初步筛选选定研究目标,然后结合实地调研进

行深人的基本面分析,并完成财务分析预测及价值评估模型,在力求获得准确的估 值结果的基础上,形成明确的投资建议,最终纳入基金股票库。在形成基金股票库 的过程中,本基金还将参考条件特征选股模型所给出的分析,以求进一步完善。条 件特征模型是基于对大量股票价格正常及异常变动的研究,对包括行业差异等诸 多因素进行分析,以获取评估公司内在价值的相关参数,从而确定被市场高估或低 此外,本基金还将分析、判断新股的二级市场定价,评估新股一、二级市场间的 差价幅度。对于认定有投资价值的新股进行认购。

(二)投资管理的基本程序

1、投资决策

投资决策委员会定期召开会议,对阶段性的投资组合整体风险水平和资产分 配比例做出讨论和决议;

金融工程小组利用集成市场预测模型和风险控制模型对市场、行业、个券、个

股进行分析和预期收益测算,研究部门从基本面分析对行业、个券、个股和市场走 势提出研究报告,开放式基金注册部门提供申购、赎回与转换的动态情况,供基金 经理参考; 3、构建组合 基金经理根据投资决策委员会决议及金融工程小组的研究成果,以及申购、赎

回的动态情况,在综合判断的基础上,在授权范围内设计和调整投资组合; 4. 交易执行

基金经理利用电子交易系统和银行间债券交易系统向独立的交易部门下达交 易指令; 5、归因分析

金融工程小组利用公司开发的归因分析系统对投资组合中整体资产配置、股票行业配置、债券产品和期限配置、个股和个券选择、买卖成本等因素对整体业绩 的贡献进行分析。该归因分析系统将为基金经理进行积极投资风险的控制和调整 6、监察稽核

监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

1、决策流程

投资决策委员会将最终决策下达至基金经理,由基金经理落实投资决策委员 会的决定。根据投资决策委员会的决定,基金经理必须组织研究部和金融工程小组 开展进一步策划,对单个投资品种及权重,期限构成和数量等进行进一步的细化, 提出完整的操作规划。 2、交易过程

基金经理将投资指令下达给集中交易部,由交易员组织实施具体操作,操作过程中交易员须提出完成组合投资的时间安排和价格控制目标,并开展交易。 3、评估过程

基金运作进行评估,主要包括两方面的内容,一是对投资组合构建执行情况的 评估,主要是评估交易完成进度、交易价格目标的实现情况、构建过程中市场流动性等变化对基金建仓成本的影响等;二是组合投资构建后对整个组合风险、收益等

4、归因分析与调整

基金经理在归因分析报告的基础上,根据宏观经济、市场走势和投资品种收益率等变化对投资组合进行调整,并根据调整要求对交易员下达投资指令,交易员完 成投资指令、实现投资组合的调整。 (四)投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定,运作管理本基金:

1、本基金投资组合应遵循下列规定: (1)本基金投资于股票、债券的比例,不低于本基金资产总值的80%;

(2)本基金持有1家上市公司的股票,不超过本基金资产净值的10%; (3)本基金与由基金管理人管理的其它基金持有1家公司发行的证券的总和,不 超过该证券的10%; (4)中国证监会的其它比例限制。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。 2、禁止用本基金资产从事以下行为:

(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)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者其基金管理人、基金

托曾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;

当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。 (五)基金的融资

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。

十一、基金的业绩比较基准 基金整体业绩比较基准 =35%×天相转债指数收益率+30%×天相280指数 收益率 + 30% × 天相国债全价指数收益率 + 5% × 金融同业存款利率

正平于30%、人们通过主切158级投篮平于05%。立城时到土于80%平 十二、基金的风险收益特性 本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风

险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风 险为:利率风险,政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营 风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险, 管理风险,巨额赎回风险等。 十三、基金的投资组合报告

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。 基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7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2015年6月30日。

序号	项目	金額(元)	占基金总资产的 比例(%)
1	权益投资	1,900,021,167.40	76.98
	其中:股票	1,900,021,167.40	76.98
2	固定收益投资	373,121,277.80	15.12
	其中:债券	353,065,277.80	14.31
	资产支持证券	20,056,000.00	0.81
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	83,336,481.67	3.38
	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	60,149,003.66	2.44
7	其他资产	51,438,039.91	2.08
8	合计	2,468,065,970.44	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	75,346,496.00	3.16
В	采矿业	-	-
C	制造业	1,236,426,981.07	51.79
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	27,727,488.00	1.16
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	66,800,387.20	2.80
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	204,812,112.63	8.58
J	金融业	121,024,720.00	5.07
K	房地产业	45,997,982.50	1.93
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	_	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	_	-
Q	卫生和社会工作	_	-
R	文化、体育和娱乐业	121,885,000.00	5.11
S	综合	_	-
	合计	1.900.021.167.40	79.59

2.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	值比例(%)
1	002250	联化科技	9,500,000	212,800, 000.00	8.91
2	002241	歌尔声学	5,280,485	189,569, 411.50	7.94
3	600079	人福医药	3,306,200	122,494, 710.00	5.13
4	601166	兴业银行	7,000,000	120,750, 000.00	5.06
5	002063	远光软件	3,000,000	93,810,000.00	3.93
6	600518	康美药业	4,600,000	81,558,000.00	3.42
7	601098	中南传媒	3,500,000	80,185,000.00	3.36
8	300115	长盈精密	2,400,000	79,944,000.00	3.35
9	600598	*ST大荒	4,442,600	75,346,496.00	3.16
10	300208	恒顺众昇	925,858	73,596,452.42	3.08

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	2,119,000.00	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	271,204,000.00	11.36
	其中:政策性金融债	271,204,000.00	11.36
4	企业债券	78,853,827.90	3.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	888,449.90	0.04
8	其他	-	-
9	合计	353,065,277.80	14.79

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	150403	15农发03	800,000	80,488,000.00	3.37
2	150202	15国开02	700,000	70,378,000.00	2.95
3	140223	14国开23	500,000	50,200,000.00	2.10
4	140443	14农发43	300,000	30,081,000.00	1.26
5	120229	12国开29	300,000	30,009,000.00	1.26

证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元)

设告期末按公允价值占基金资产净值比例大

本基金本报告期末未持有贵金属投资 2.8 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

2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 2.9.1 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。 2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

2.10.1 本基金投资国债期货的投资政策 2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货

2.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

2.11 投资组合报告附注

2.11.1本报告期内,本基金投资的北大荒于2015年6月23日收到中国证券监督管理委员会《行政处罚及市场禁入事先告知书》。除此之外,基金投资的前十名其 也证券的发行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 2.11.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票 库之外的股票。

序号	名称	金額(元)	
1	存出保证金	1,031,925.88	
2	应收证券清算款	30,443,276.15	
3	应收股利	-	
4	应收利息	7,628,176.69	
5	应收申购款	12,334,661.19	
6	其他应收款	_	
7	待摊费用	_	
8	其他	_	
9	合计	51,438,039.91	

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。 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。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。

2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

一)基金净值表现 历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较(截至时 间2015年06月30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 2004-8-2 4(合同生 效日)至 2004-12- 31	0.20%	0.32%	-1.66%	0.52%	1.86%	-0.20%
2005-1-1 至 2005-12- 31	12.75%	0.79%	3.14%	0.49%	9.61%	0.30%
2006-1-1 至 2006-12- 31	124.82%	1.15%	48.50%	0.61%	76.32%	0.54%
2007-1-1 至 2007-12- 31	108.00%	1.53%	80.75%	1.25%	27.25%	0.28%
2008-1-1 至 2008-12- 31	-38.20%	1.68%	-30.84%	1.22%	-7.36%	0.46%
2009-1-1 至 2009-12- 31	60.64%	1.37%	39.49%	1.05%	21.15%	0.32%
2010-1-1 至 2010-12- 31	7.53%	1.18%	-7.08%	0.68%	14.61%	0.50%
2011-1-1 至 2011-12- 31	-15. 12%	1.01%	-11.14%	0.55%	-3.98%	0.46%
2012-1-1 至 2012-12- 31	4.03%	0.83%	4.85%	0.49%	-0.82%	0.34%
2013-1-1 至 2013-12- 31	9.94%	1.04%	-1.86%	0.61%	11.80%	0.43%
2014-1-1 至 2014-12- 31	34.81%	0.91%	36.69%	0.69%	-1.88%	0.22%
2015-1-1 至 2015-6-3	36.05%	1.99%	5.82%	1.68%	30.23%	0.31%

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)基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率1.2%计提。计算方法如下:

H = E × 1.2% ÷ 当年天数 H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计提,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)基金托管人的托管费

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 × 0.25% ÷ 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,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)投资交易费用 (4)基金信息披露费用 (5)基金份额持有人大会费用

(6)与基金相关的会计师费和律师费 (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有关法律法规及相应 协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

2、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 资产的损失,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。

3、费用调整 基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费,此项调 整不需要基金份额持有人大会决议通过。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费。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 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人实施差别

养老金客户指基本养老基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 克国,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 他投资人 通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔

其他投资人申购本基金基金份额申购费率如下所示: (1)投资者选择交纳前端申购费,申购费按申购金额采用比例费率。投资人在

之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

0≤M<1007 M≥1000万 每笔1000 (2)投资者选择交纳后端申购费,申购费率按持有时间递减,申购费率见了

44.	
持有期限Y	后端申购费率
Y<1年	1.50%
1年≤Υ<2年	1.20%
2年≤Y<3年	1.00%
3年≤Y<4年	0.80%
4年≤Y<5年	0.40%

(3) 本基金的申购费用不列入基金资产 2、赎回费用

本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.5%,按持有期递减。赎回费用的 75%做为本基金的注册登记费用,剩余25%留做基金资产。具体费率如下:

注:一年指365天,两年为730天,依此类推 3、转换费用 基金转换的总费用包括转出基金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

转出金额=转出份额(转出基金当日基金份额净值-转出基金赎回费 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算收取,具体计 算公式如下:

基金转换申购补差费= max [(转入基金的申购费-转出基金的申购费),0],即转人基金申购费减去转出基金申购费,如为负数则取0 转人金额 = 转出金额一基金转换申购补差费

转人份额 = 转入金额/转入基金当日基金份额净值 转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

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

注1:转入基金份额的计算结果四舍五入,保留到0.01份基金份额,由此产生的 误差计人基金资产 注2:本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务

注3: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。

活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。 十六、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

四、基金托管人	更新了基金托管人的有关资料。
五、相关服务机构	更新了部分直销以及代销机构的有关信息。
六、基金日常申 购、赎回及基金转 换	1.更新了广州、西安、成都分公司的联系人信息; 2.更新了最低申购金额限制。
九、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
十、基金的业绩	更新了基金合同生效以来的投资业绩。
二十一、对基金投 资人的服务	更新更新电子直销渠道的支持银行及支持业务的更新,详见招募 说明书。
二十二、其他应披 露事项	披露了自2015年2月24日至2015年8月24日期间本基金的公告信息。
	华安基金管理有
	一○

二〇一五年十月八日