

信息披露 Disclosure

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2015 年度 报告 摘要

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员均符合无。无。

4.3 管理人报告期内本基金运作遵守诚信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.4 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.4.1 公平交易制度和控制方法
根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合能公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行投资决策规则,以保证投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时间上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按照意愿独立进行业务决策,集中申报时投资组合名义对外进行申报,若业务内容完全一致进行申报并中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资指令在合规监察员监督与下,进行公平协商分配。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则,通过不同集团的wind屏,发布询价需求和结果,做市信息分开,若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以投资组合名义向集中交易室下达交易指令,交易员以此进行投标,以确保各投资组合与投资组合投资意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理部投资监督与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种,进行场外非公开发行业股票申购,以公司名义进行的债券一级市场申购,不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,根据市场公允的第三方信息(如中债的债券估值等),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易及时机和交易价差进行分析。

4.4.2 公平交易制度的执行情况
本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。本基金管理人通过建立有效的公平交易制度,在不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.4.3 异常交易行为的专项说明
根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合监察稽核部会同基金投资、交易部门制定了公募基金,专针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的全日反向交易监控,并在投资交易系统中进行了设置,实现了完全的系控控制。同时加强了对基金、专户的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查,风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为1次,未出现异常交易。原因是各投资组合分别按照其投资策略交易时,虽然买卖证券成交类数较多,但由于个股流动性较差,交易量稀少,致使成交较少的单边交易量仍超过当日成交量比例。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,未发现有异常。

4.5 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析
德意志指数(DAX)全年表现良好,组合分红在境内收入占比1.29%,但由于欧元相对于人民币出现明显贬值,以及人民币计价,DAX指数全年上涨14.63%,仍然跑赢了正收益。受到全球风险偏好上升,带动欧元对出口的提振,以及美国经济持续走强等因素影响,德国的大众汽车排且同属DAX指数的影响仍将持续,但已显著弱化。在叙利的移民问题以及巴黎恐怖袭击事件对欧洲市场造成的风险溢价产生了负面影响。总体看,德国经济韧性较强,在欧元区内部仍然最佳,是投资欧洲大市的首选市场。

4.5.2 报告期内基金的投资表现
截至2015年12月31日,本基金份额净值1.002元,本报告期净值增长率为1.83%,同期业绩比较基准增长率为4.23%。

4.6 管理人对外宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
2016年我们预期经济在长期阵痛后有明显表现好转,首先是宽松的货币政策,其次经过多年消化,各国的财政状况已明显改善改善,劳动生产率的全球竞争力有所提高,劳动市场出现回暖势头,房地产领域资金流入回升,美国资产价格回升,而俄罗斯则是服务业PMI连续760以上。欧洲经济经过多年来的改革,去杠杆,正在部分领域显现经济复苏态势。而欧元区债务危机全球处于低位,但是,欧洲也面临地缘政治、移民等不利因素。

4.7 DAX ETF联接基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.7 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
1.估值政策及重大变化
2.估值政策和重大变化对基金资产净值及当期损益的影响
3.有参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1)公司方面
公司基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预估情况的说明
本基金报告期内不存在基金持有人数少于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况
托管人,在报告期内,管理人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内基金基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金估值和赎回申购价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在业务操作方面严格遵守基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本报告期内基金估值程序等事项的说明,华安基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预估情况的说明
本基金报告期内不存在基金持有人数少于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况
托管人,在报告期内,管理人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内基金基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金估值和赎回申购价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在业务操作方面严格遵守基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本报告期内基金估值程序等事项的说明,华安基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预估情况的说明
本基金报告期内不存在基金持有人数少于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况
托管人,在报告期内,管理人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内基金基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金估值和赎回申购价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在业务操作方面严格遵守基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本报告期内基金估值程序等事项的说明,华安基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预估情况的说明
本基金报告期内不存在基金持有人数少于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况
托管人,在报告期内,管理人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内基金基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金估值和赎回申购价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在业务操作方面严格遵守基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本报告期内基金估值程序等事项的说明,华安基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预估情况的说明
本基金报告期内不存在基金持有人数少于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况
托管人,在报告期内,管理人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内基金基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金估值和赎回申购价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在业务操作方面严格遵守基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本报告期内基金估值程序等事项的说明,华安基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本报告期不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预估情况的说明
本基金报告期内不存在基金持有人数少于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况
托管人,在报告期内,管理人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守诚信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内基金基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金估值和赎回申购价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在业务操作方面严格遵守基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本报告期内基金估值程序等事项的说明,华安基金估值委员会,组成人员包括:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、监察稽核部总监、指数投资部总监、基金运营部总监及相关人员无。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价格的影响程度,评估对基金估值的影响程度,确定采用的估值方法,确定该证券的公允价值;同时采用确定的方法以及采用方法对相关证券估值与基金的托管银行进行协商。

相关人员专业胜任能力及工作经历
俞昌益,基金投资部基金估值部总监,工学硕士学历。曾在台湾证券证券金融产业分析师投资经理,台湾瑞泰资产管理公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。2008年4月加入华安基金管理有限公司,历任华安稳健精选、华安中证500指数基金、华安弘利股票基金、华安宏观经济策略型基金的基金经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,基金投资部基金估值部总监。

赵 毅,研究部首席。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司合管理部总监,电子商务部总监、上海普信部总监,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员,债券投资经理助理,固定收益投资经理。现任华安稳健精选、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债债券基金基金经理,华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安季鑫短期理财、华安财资货币、华安年红基金基金经理,固定收益部副总监。

许之远,指数投资部副总监,理学博士,CFA国际基金金融工程师。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后,后进入从事基金工程工作,2006年加入华安基金管理有限公司,历任研究发展部策略分析员,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接,华安上证300指数证券投资基金(LOP),华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部副总监。

陈 兵,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CFA中国注册会计师,曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具核查意见和报告。

4.8 基金参与或决定估值的事项
本基金的基础基金经理参与基金的估值。

5.参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突
参与估值流程各方之间无其他重大利益冲突。

6.已签约的任何定价服务协议与程度等事宜无。

4.9 管理人报告期内基金