华安大中华升级股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2017年第2号

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

二〇一七年十二月

重要提示

华安大中华升级股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依照有关法律法规及约定发起,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2011年3月7日《关于核准华安大中华升级股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]328号)核准。本基金基金合同自2011年5月17日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者在认购(或申购)基金前请认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明持有对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《证券法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核,除特别说明外,本招募说明书摘要所载内容截止日为2017年11月17日,有关财务数据截止日为2017年9月30日,净值表现截止日为2017年6月30日。

一、基金的名称

本基金名称:华安大中华升级股票型证券投资基金。

二、基金的类型

本基金类型:契约型开放式、股票型基金。

三、基金的投资目标

在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上,追求中长期资本增值,力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。

四、基金的投资方向

本基金投资范围为大中华地区企业,包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场(如香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场)发行的股票、存托凭证及其他衍生产品等;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于东亚及东亚区域市场,包括韩国、印尼、马来西亚、泰国等证券市场交易的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等;投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金所指的大中华地区企业是企业注册地或企业主营业务收入主要来源地属于中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区区域范畴内。

本基金的投资组合为:股票资产不低于基金资产的60%,其中不低于85%的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业,不高于15%的股票资产投资于东亚及东亚区域市场;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

五、基金的投资策略

(一)投资策略

1.资产配置策略

本基金将通过全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,利用数量模型工具,分析和比较股票、债券等不同金融工具的风险收益特征,并以此为依据,对基金整体资产配置比例进行确定。同时,本基金将定期、或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整,以保持基金资产配置的有效性。

2.股票投资策略

本基金以价值和成长投资理念为导向,采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。本基金将以经济升级受益作为行业配置和个股挖掘的主要线索,通过对于经济结构调整的跟踪和研究,以及对于地区资源属性比较,对各行业的发展趋势和投资前景进行预期,选择优势行业作为主要投资目标。同时通过对大中华地区的股票基本面的分析和研究,考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平,挖掘受益于中国地区经济升级,并具备中长期持续增长或阶段性高速成长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。

对于中国大陆地区企业,本基金挖掘并投资于偏中代表整个经济发展趋势的行业或主题。本基金中期重点关注以下几类行业:

战略性新兴行业:国家中长期科学和技术发展规划纲要把建设创新型国家作为战略目标,把可持续发展作为战略方向,把争夺经济科技制高点作为战略重点。在这一规划下,战略性新兴行业将逐步成为经济社会发展的主导力量。本基金认为,战略性新兴行业必须掌握关键核心技术,具有市场需求前景,具备资源能耗低、带动系数大、就业机会多、综合效益好的特征。在选择战略性新兴行业时,将着重考虑以下几个因素:一是产品要有稳定并有发展前景的市场需求;二是要有良好的经济技术效益;三是要能带动一批相关产业的兴起。本基金根据国民经济和社会发展五年规划、产业调整与振兴规划以及区域发展战略等,确定节能环保、信息技术、新材料和生物医药等行业为中长期的战略性新兴产业,未来将根据经济社会的发展和政策的演变适当调整战略性新兴产业的范畴。

消费升级行业:当前在经济增长的三驾马车中,消费是最为稳定且持续增长的因素,随着我国居民收入水平提高,消费升级趋势越来越明显,导致消费升级受益行业公司业绩持续稳定增长。本基金将对影响居民收入水平及消费结构的因素以及消费结构的变化趋势进行跟踪分析,发掘不同时期的消费升级主题,在不同子行业间进行积极的轮换,不断优化投资资产结构。

传统行业中的技术升级:传统行业中的技术升级也是本基金重点关注的投资主题,创新投入和新科技的应用将为传统行业注入新的活力,带动技术升级和盈利模式的创新,本基金在投资传统行业时,将通过技术应用前景、市场需求和经济效益三方面论证企业发展战略和市场推进措施,挖掘技术升级带来的投资机会。

对于香港与台湾地区企业,本基金中期在行业选择方面重点关注:一是中国大陆的升级趋势给当地行业带来的新机遇,二是当地部分产业配合中国大陆的升级趋势而产生的自发性的升级。包括不限于:

金融行业:CEPA与ECFA的签定推进了两岸三地金融一体化,随着中国大陆内部金融深化与金融创新进程不断推进,对金融服务的需求将持续快速增长,从而给香港与台湾的金融业带来新的发展机遇。

旅游行业:随着中国大陆的消费层次的可支配收入持续增长,升级不断提升,两岸三地的旅游业的开放,将带动大量大陆居民出境旅游,从而带动当地旅游业以及相关的服务业的迅速增长。

新兴专业服务行业:中国大陆的消费升级以及产业升级会产生大量对新型服务业的需求,包括法律、税务、咨询、教育培训、医疗、家政等等,香港与台湾在这些领域的发展大大领先于中国大陆地区,因此,随着大陆地区对这类行业的需求增长,也为香港/台湾的此类相关行业带来新的发展机遇。

信息技术行业:随着中国大陆信息化水平的不断提高,对新兴信息技术产品的需求不断增长,台湾的信息技术产业与电子制造业将成为中国大陆重要的合作对象,配合台湾目前的产业升级,未来将较大的发展空间。

本基金从定量及定性两方面对上市公司进行分析筛选,并通过估值模型精选出投入产出效率得到提升和经营效率得到提高的优势企业进行重点投资。

① 定量分析

本基金在选择个股时充分利用上市公司的财务数据和市场数据,从上市公司的盈利能力、成长能力、运营能力、负债水平等各个方面进行量化筛选。本基金采用的量化指标主要包括以下几类:

盈利能力指标:主要包括净资产收益率、主营业务利润率、总资产收益率、内部收益率等;

成长能力指标:主要包括长期主营业务收入增长率、长期利润增长率等;

运营效率指标:主要包括总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等;

负债水平指标:主要包括资产负债率、流动比率、速动比率等。

② 定性分析

产业链分工中占据高端环节或具有产业升级潜力;

从高技术向高新技术转化,从低附加值向高附加值转化,从制造型向创造型转化,从而节约资源、减少消耗、降低成本、减少污染;

良好的公司治理结构,优秀、诚信的公司管理层;

财务透明,资产质量及财务状况较好,良好的历史盈利记录;

行业集中度行业地位,具备独特的核心竞争优势和定价能力;

规模效应明显;

具备中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力。

此外,根据公司业绩的长期增长趋势以及同类企业的平均估值水平,应用估值模型选择价值被市场显著低估的企业进行投资,采用的估值模型包括资产重置价格、市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、企业价值倍数(EV/EBITDA)、现金流贴现法(DCF)等。

3.固定收益投资策略

本基金管理人对宏观经济运行趋势及财政货币政策变化作出判断,运用数量化工具,对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测,并综合考虑利率变化对债券品种的影响,收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素,构造债券组合。

主要的债券投资策略是:大期调整策略、收益率曲线策略、债券类属配置策略、骑乘策略、信用利差策略等。具体如下:

① 久期调整策略

本基金将根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

② 收益率曲线策略

在久期确定的基础上,根据对收益率曲线形状变化的预测,采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

③ 债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。

④ 骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况(通常是收益率曲线短端的1-3年),买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,随着基金持有债券时间的延长,债券的剩余期限将缩短,到期收益率将下降,基金从而可获得资本利得收入。

⑤ 信用利差策略

企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响,相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律,内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动,另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将倾向或扩大,管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。

4.金融衍生品投资策略

本基金参与衍生工具交易的主要目的是组合避险和有效管理。如通过选择恰当的金融衍生品降低因市场风险大幅增加给投资组合带来的不利影响;利用金融衍生品交易成本低、流动性好等特点,有效帮助投资组合及时调整仓位,提高投资组合的运作效率等。

此外,在符合有关法律法规规定的前提下,本基金还可通过证券借贷交易和回购交易等投资增加收益。未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在更新招募说明书中公告。

(二)投资决策依据和决策程序

1.决策依据

(1)依照国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定,依法决策是本基金进行投资的前提;

(2)全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境和证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础;

(3)依据投资对象收益和风险的配比关系,在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金修正投资者利益的重要保障;

(4)宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境和证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础;

(5)依据投资对象收益和风险的配比关系,在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本基金修正投资者利益的重要保障。

2.决策程序

(1)决策机制

本基金运行投资决策委员会下的基金经理负责制,投资决策委员会的主要职责是确定基金大类资产的配置策略,以及重大投资方案,基金经理的主要职责是在投资决策委员会批准的大类资产配置范围内构建和调整投资组合,基金经理负责下达投资指令。集中交易部合法、合规地执行交易指令。

(2)资产配置阶段

基金经理在研究宏观经济的支持下,对不同类别的大类资产的收益风险状况作出判断。宏观研究员提供宏观经济分析,策略研究员提供策略建议,股票研究员提供行业和个股配置建议,数量研究员结合本基金的产品定位和风险控制要求提供资产配置的定量分析。基金经理结合自己的分析判断和研究员的投资建议,根据合同规定的投资目标、投资理念和投资范围拟定大类资产的配置方案,向投资决策委员会提交投资策略报告。投资决策委员会审议投资策略报告,并做出投资决议。

(3)组合构建阶段

研究员负责构建股票的备选库。基金经理在其中选择投资品种,构造具体的投资组合及操作方案,并决定交易的数量和时机。

(4)交易执行阶段

由集中交易部负责投资指令的操作和执行,集中交易部合法、合规地执行交易指令,对交易过程中出现的任何情况,负有监控、处置的责任。集中交易部确保将无法自行处置并可能影响指令执行的交易状况和市场变化向基金经理及时反馈。

(5)风险评估和绩效分析

风险管理决定期和不定期地对基金组合进行风险评估和绩效分析并提交报告。风险评估报告帮助投资决策委员会和基金经理了解投资组合承受的风险水平和风险的来源,绩效分析报告帮助投资决策委员会评估投资决策的成功,以及组合收益来源是否是依靠实现既定策略获得。风险管理定期向投资决策委员会提交风险评估和绩效分析报告,并及时反馈给策略基金经理。对重大的风险事项可报告风险控制委员会。

投资决策委员会在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要调整上述投资决策程序。

如期聘请、更换独立投资顾问,基金管理人有权将在遵循上述投资策略的前提下,对其投资决策程序进行适当调整,无需召开基金份额持有人大会。

(三)投资限制

1.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)购买不动产。

(2)购买房地产抵押按揭。

(3)购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。

(4)购买实物商品。

(5)除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的10%。

(6)利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外。

(7)参与未持有基础资产的卖空交易。

(8)从事证券承销业务。

(9)向他人贷款或者提供担保。

(10)从事承担无限责任的投资。

(11)买卖其他基金份额,但是监管部门另有规定的除外。

(12)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人、境外资产托管人发行的股票或者债券。

(13)买卖与其基金管理人、基金托管人、境外资产托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管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。

(14)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。

(15)不公平对待不同客户或不同投资组合。

(16)除法律法规规定以外,向任何第三方泄露客户资料。

(17)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

2.投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(2)基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值的10%。

(3)基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场挂牌证券资产不得超过基金资产净值的5%。

(4)基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。

上述投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本,同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券,并假设对持有的股本权证行使转换。

(5)基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的15%。

上述“非流动性资产”是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(6)本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的10%,但持有货币市场基金不受此限制。

(7)同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金,不得超过该境外基金份额的20%。

(8)为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

3.金融衍生品投资

(1)本基金投资衍生品仅限于投资组合避险或有效管理,不用于投机或放大交易,同时严格遵守下列规定:

①本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%;

②本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资看台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

③本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的5%。

④基金管理人应当在本基金合计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

(2)衍生品投资模拟及风险管理策略

①风险管理原则:根据基金状况,市场状况以及不同衍生品的风险状况,确定可投资的衍生品种类,并对于各可交易品种,设立风险控制标,包括合约数量的限额、止损点、VAR值等;

②基金经理在交易限额内进行衍生品投资并做动态调整;

③风险管理部实时监控衍生品交易情况,对风险指标进行动态预测与监管,运用VAR模型计算每日各衍生品的风险价值,并加总获得基金总体衍生品投资的风险值,严禁按相关性对不同方向的仓位进行抵消,一旦发现风险事件及时通知基金经理,并向公司高管汇报;

④交易系统内设置警戒线,接近警戒线时自动预警;

⑤一旦价格触及止损点,风险管理部立即通报基金经理,并有权强制平仓,避免出现严重的风险事件;

⑥风险管理部在会计年度结束后60个工作日内基金经理出具书面报告,并报证监会;

⑦合规监察稽核岗建立有效的内部稽核制度,对内部控制的充分性和有效性进行独立检查与评价。

4.本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:

(1)所有参与交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2)应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

(3)借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4)本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(5)本基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负有赔偿责任。

5.基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易,逆回购交易中发生的任何损失负有赔偿责任。

(1)所有参与正回购交易的对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2)参与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出回购证券的市值保持在卖出证券市值的102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出回购证券以满足索赔需要。

(3)买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4)参与正回购交易,应当对购入证券实施市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5)基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负有赔偿责任。

6.基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。本项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金、集合计划总资产。

7.若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,我使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在履行适当程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

六、基金的管理人概况

本基金由博时基金管理有限公司(简称“中国银行”)依照《证券投资基金管理人管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《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	主要更新内容
四、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
五、基金的业绩	更新了基金合同生效以来的投资业绩。
六、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
十七、基金托管人	更新了基金托管人相关信息。
十九、相关服务机构	更新了销售机构的部分信息;
二十四、其他应披露事项	披露了自2017年5月17日至2017年11月17日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一七年十二月二十九日

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港	中国香港	72,000	20,567,209.82	9.77
2	Largan Precision Co., Ltd.	大立光电股份有限公司	3008 TT	台湾	中国台湾	8,000	9,412,909.53	4.47
3	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	台湾积体电路制造股份有限公司	2330 TT	台湾	中国台湾	142,000	6,729,792.50	3.20
4	FLEXIUM INTERCONNECT	台郡科技股份有限公司	6269 TT	台湾	中国台湾	252,907	6,615,827.67	3.14
5	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港	中国香港	114,000	5,806,831.34	2.76
6	Nine Dragons Paper (Holdings) Limited	玖龙纸业(控股)有限公司	2689 HK	香港	中国香港	396,000	5,168,107.93	2.45
7	TAIMED BIOLOGICS INC	中裕新药股份有限公司	4147 TT	台湾	中国台湾	110,000	4,815,907.20	2.29
8	CATCHER TECHNOLOGY CO., LTD.	可成科技股份有限公司	2474 TT	台湾	中国台湾	69,000	4,455,808.68	2.12
9	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港	中国香港	89,200	4,365,485.11	2.07
10	China Pacific Insurance (group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港	中国香港	145,400	4,157,139.98	1.97

5.报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

8.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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9.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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10.投资组合报告附注

10.1本报告期内,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。

10.2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。

10.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	280,614.12
3	应收股利	428,680.83
4	应收利息	2,347.34
5	应收申购款	44,173.26
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	755,815.55

10.4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。

10.5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。

九、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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(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2017年6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
2017年1月1日至2017年6月30日	14.41%	0.66%	19.13%	0.63%	-4.72%	0.03%
2016年1月1日至2016年12月31日	-0.25%	1.18%	9.52%	1.05%	-9.77%	0.13%
2015年1月1日至2015年12月31日	-4.47%	2.06%	-4.38%	1.30%	-0.09%	0.76%
2014年1月1日至2014年12月31日	11.18%	0.86%	5.10%	0.76%	6.08%	0.10%
2013年1月1日至2013年12月31日	19.64%	0.97%	0.80%	0.93%	18.84%	0.04%
2012年1月1日至2012年12月31日	18.05%	0.91%	18.28%	0.97%	-0.23%	-0.06%
自基金成立(2011年5月17日)至2011年12月31日	-20.20%	1.59%	-23.41%	1.71%	3.21%	-0.12%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1.基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值150%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×150%÷当年天数

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2.基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购费用

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

2.赎回费用

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的申购与赎回”一章。

3.销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费,用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

(三)其他费用

1.基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用(out-of-pocket fees);

2.基金合同生效以后的信息披露费用;

3.基金份额持有人大会费用;

4.基金合同生效以后的会计师费和律师费以及其他为基金利益而产生的中介机构费用;5.基金的资金汇划费用;

6.外汇兑换交易的相关费用;

7.与基金财产缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等;

8.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;

9.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1至5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。本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(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。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(六)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规和国外市场的规定履行纳税义务。

十一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1.名称:华安基金管理有限公司

2.住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道89号国金中心二期31-32层

3.法定代表人:朱学华

4.设立日期:1998年6月4日

5.批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]24号

6.注册资本:15亿元人民币

7.组织形式:有限责任公司

8.经营范围:从事基金管理业务,发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务

9.存续期间:持续经营

10.联系电话:(021)38969999

11.客户服务电话:400838-50099

12.联系人:王艳

13.网址:www.huaan.com.cn

(二)注册资本和股权结构

1.注册资本:15亿元人民币

2.股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
国泰君安创新投资有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

(三)主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

(1)董事会

朱学华先生,大专学历,历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。

童威先生,博士研究生学历,历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上海都桂基金管理有限责任公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部副总经理兼董事办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生,本科学历,高级政工师职称。历任上海红星船厂党委书记,上海东风机械(集团)公司总裁助理、副总裁,上海全兴网络科技股份公司总经理,上海赛事商务有限公司董事长、总经理,上海东浩工艺品有限公司董事长,上海国盛集团机械投资有限公司党委副书记、总裁、董事,上海建筑材料(集团)总公司党委书记、董事长(法定代表人)、总裁。现任上海工业投资(集团)有限公司党委副书记、执行董事(法定代表人)、总裁。

马名刚先生,工商管理硕士,高级会计师。历任风凰股份有限公司副董事长、总经理,上海东方上市企业博览中心副总经理。现任锦江国际(集团)有限公司副总裁兼计划财务部经理及金融事业部总经理,上海锦江国际投资管理有限公司董事长、兼总经理,上海锦江旅游股份有限公司董事,华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海绿城文化传播有限公司董事,Crystal Bright Developments Limited董事,史带财产保险股份有限公司董事,上海上国投资产管理有限公司董事。

董耀华先生,大学学历,高级经济师,历任上海市审计局基建处科员、副主任科员、处长助理、副处长,国定资产投资审计处副处长(主持工作)、处长,上海市审计局财政审计处处长,上海电气(集团)总公司财务总监,上海电气(集团)总公司副总裁、财务总监,现任上海电气(集团)总公司董事长,上海自立(集团)股份有限公司董事长,上海临港控股股份有限公司董事。

魏小刚先生,经济学博士,历任国泰君安证券股份有限公司投资银行二部部业务董事、企业融资总部副总裁、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、商管理总部总经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上海分公司主任、国泰君安证券股份有限公司总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司总裁兼董事会秘书。

独立董事:

吴恒炀先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市金茂律师事务所主任、现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大君先生,研究生学历,教授,现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师,中国工业经济学会副会长,财政部会计准则委员会咨询专家,财政部企业内部控制标准委员会委员,香港中文大学名誉教授,复旦大学管理学院兼职教授,上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

(2)监事会

张志红女士,经济学博士,历任中国证监会上海监管局原上海证券办机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务,长城证券有限责任公司党委书记、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员,中小企业融资商业总经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司业务总监兼投行业务委员会副总裁,华安基金管理有限公司监事。

许研先生,研究生学历,曾任化安咨询管理有限公司董事总经理,麦理根(McLagan)公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司人力资源部高级总监,华安资产管理(香港)有限公司董事。

诚慧女士,研究生学历,经济师,历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员,集中交易部总监助理。现任华安基金管理有限公司集中交易部总监。

(3)高级管理人员

朱学华先生,大专学历,18年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生,博士研究生学历,16年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限责任公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部副总经理兼董事办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛静女士,研究生学历,16年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授,中国证监会上海证券办机构处副处长,中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

2.本基金基金经理

鲁炜佩先生,工业工程学硕士,21年证券、基金行业从业经历,具有中国大陆基金从业资格,曾在台湾证券任金融产业分析师及投资经理,台湾摩根士丹利投信股份有限公司董事总经理,台湾中信证券投资信息部,台湾保德信投信任基金经理。现任华安基金管理有限公司基金经理。

2008年4月加入华安基金管理有限公司,任全球投资部总监。2010年9月起担任华安吉祥精选股票型证券投资基金的基金经理,2011年5月起同时担任本基金的基金经理,2014年4月起担任其全投资部副总监,2014年3月至2016年9月同时担任华安吉祥成长股票型证券投资基金的基金经理,2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理,2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部副总监,2015年2月至2016年9月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年3月起同时担任华安信息产业股票型证券投资基金的基金经理,2015年4月至2016年9月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。

苏祈扬先生,博士研究生,13年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后于研究发展部、战略策划部工作,担任行业研究员和产品经理职务,目前任职于全球投资部,担任基金经理职务。2010年9月起同时担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理,2011年5月起同时担任本基金的基金经理,2015年6月至2016年9月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年3月起同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金、华安全球美元收益债券型证券投资基金