(上接D18版)

传真：021)63326173
客户服务电话：021)962506,400-8888-506
网址:www.dfzq.com.cn
(45)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:魏云鹏
电话：0755)83516094
传真：0755)83516199
客户服务电话：0755)82288968
公司网站:www.cc168.com.cn
(46)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐志明
电话：021)68816000-1876
传真：021)68815009
客户服务电话：10108998
网站:www.ebscn.com
(47)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人:吴志明
电话：020)87322668
传真：020)87325036
客户服务电话:961303
网址:www.gzs.com.cn
(48)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话：0431)85096709
传真：0431)85096795
客户服务电话：0431)96688
网址:www.nesc.cn
(49)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市九江路111号
法定代表人:蒋元真
电话：021)62470304
传真：021)65213164
客户服务电话:800-6200-071
网址:www.962518.com
(50)国联证券股份有限责任公司
注册地址:无锡市县前东街168号国联大厦
法定代表人:范炎
电话：0510)82831662
传真：0510)82830162
客户服务电话:400-888-5288
网址:www.glsc.com.cn
(51)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区八卦三路平安大厦3楼
法定代表人:叶黎成
电话：0755)22627802
传真：0755)82433794
客户服务电话:95511
网址:www.PA18.com
(52)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人:李工
电话：0551)5161666
传真：0551)5161600
客户服务电话：0551)5161671
网址:www.hazq.com
(53)国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
电话：0771)5539262
传真：0771)5539033
客户服务电话:全国:400-8888-100 广西:96100
网址:www.ghzq.com.cn
(54)财富证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层
法定代表人:蒋永明
电话：0731)4403343
传真：0731)4403439
客户服务电话：(0731)4403343
网址:www.cfzq.com
(55)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:游锦辉
电话：0769)22119351
传真：0769)22119423
客户服务电话:961130
网址:www.dgzq.com.cn
(56)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层
办公地址:北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层
法定代表人:王少华
电话：010)84183389
传真：010)64482090
客户服务电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com
(57)宏源证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系电话：010)88085338
传真号码：010)62294470
客户服务电话：0991)96562、010)62294600
公司网址:www.hongyuan.com
(58)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
传真：0531)81283906
客户服务电话:95538
网址：www.qlzq.com.cn
(59)世纪证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼
法定代表人:卢长才
电话：0755)83199511
传真：0755)83199545
客户服务电话：(0755)83199511
公司网站:www.csco.com.cn
(60)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
法定代表人:王军
电话：021)68761616
传真：021)68767981
客户服务电话：021)68761616-8125
网址:www.tebon.com.cn
(61)西部证券股份有限公司
注册地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16—17层
法定代表人:刘建武
电话:029-87406172
客户服务电话:96708
网址:www.westsecu.com.cn
(62)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
电话：0931)4890100
传真：0931)4890118
客户服务电话：0931)4890100
网址:www.hlzqgs.com
(63)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:刘弘
电话：010)59226788
传真：010)59226799
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com
(64)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
办公地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人:杨小阳
电话：0755)82026521
传真：0755)82056539
客户服务电话:4006-008-008
网址:www.cjis.cn
(65)中山证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层
法定代表人:吴冰良
电话：0755)82943755
传真：0755)82940511
客户服务电话：0755)82943750
网址:www.zszq.com.cn
(66)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:倪雨林
电话：0871)3577930
传真：0871)3578827
客户服务电话：0871)3577930
网址:www.hongtazq.com
(67)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
法定代表人:朱利敏
电话：021)50586660-8636
传真：021)50586660-8611
客户服务电话：021)52574550
网址:www.longone.com.cn
(68)江南证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:朱利敏
电话：0791)6768763
传真：0791)6789414
客户服务电话：0791)6768763
网址:www.scstock.com
(69)国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
电话：0791)6289771
传真：0791)6289395
网址:www.gsstock.com
(70)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：刘汝军
电话：0471)4913998
传真：0471)4930707
客户服务电话：0471)4961259
网址:www.cnht.com.cn
(71)江海证券经纪有限责任公司
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
法定代表人:孙名扬
电话：0451)82336863
传真：0451)82287211
客户服务电话:40066-6228
网址:www.jhzq.com.cn
(72)信金证券股份有限公司
注册地址:成都市青羊区东城根上街95号
办公地址:成都市青羊区东城根上街95号16楼
法定代表人:雷波
电话：028)86690125
传真：028)86690126
客户服务电话：028)95105111
网址:www.china598.com.cn
(73)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19号富凯大厦B座701
法定代表人：林义相
电话：010)66045566
传真：010)66574468
客户服务电话：010)66045566
网址:www.txsec.com.cn
(74)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号24楼
办公地址:上海市南京西路758号博爱大厦20层-25层
法定代表人：张建华
电话：021)32229888
传真：021)62878701
客户服务电话：021)63340678
网址:www.ajzq.com、
(75)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人：张志刚
电话：010)88626476
传真：010)88656290
客户服务电话:400-800-8899
网址：www.cindasc.com
(76)中国国际金融有限公司
注册地址:中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
办公地址:中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人:李剑阁
电话：010)65051166
传真：010)65051156
客户服务电话：010)65051166
网址:www.cicc.com.cn
(77)万正证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
电话：0731)85832343
传真：0731)85832342
客户服务电话:95571
网址:www.foundersc.com
(78)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区月坛北街26号
法定代表人:丁之锁
电话：010)58568007
传真：010)58568062
客户服务电话：010)58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(79)东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：崔海涛
电话：010)66555835、010)66555637
传真：010)66555246(北京)、0591)87807312(福州)
客户服务电话：010)66555795或010)66555815
网址:www.dxzy.net
(80)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
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
(81)广发华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
电话：0591)87278701
传真：0591)87383610
客户服务电话：0591)96326
网址：www.gfhfzq.com.cn
(82)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
法定代表人:张建军
电话:020-37865070
传真:020-37865030
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn
(83)第一创业证券有限责任公司
注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
法定代表人：刘学民
电话:0755-25832583
传真:0755-25831718
客户服务电话:0755-25832583
网址:http://www.firstcapital.com.cn
(84)中天证券有限责任公司
注册地址：沈阳市和平区光荣街23号甲
办公地址：沈阳市和平区光荣街23号甲
法定代表人：李学琦
电话：024)23266917
传真：024)23255606
客户服务电话:4006180315
网址:www.stockren.com
(85)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：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人：傅毅辉
电话:0592-5161642
传真:0592-5161140
客户服务电话:0592-5163588
网址:www.xmzq.cn
(二)注册登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
法定代表人:俞妙根
电话：021)38969999
传真：021)33627990
联系人:朱永红
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
住所: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: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有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
电话：021)61238888
传真：021)61238800
联系人:金毅
经办注册会计师:马颖妮、金毅

四、基金的名称

本基金名称:华安稳定收益债券型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上,通过主动管理,获取证券的利息收益及市场价格变动收益,以追求资产持续稳健的增值。

七、基金的投资方向

本基金为债券型基金,投资范围为固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、信用等级为投资级的企业(公司)债,以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的80%-100%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股票等权益类品种的投资比例为基金资产的0%-20%。本基金权益类资产投资主要进行首次发行以及增发新股投资,并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票,不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金还可以持有股票所派发的权证和可分离债券产生的权证。

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

八、基金的投资策略

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。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例占基金资产的80%-100%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;股票等权益类品种的投资比例占基金资产的0%-20%。

2、债券投资策略(不含可转债)

本基金为债券型基金,在投资过程中我们高度重视稳健投资策略的运用。通过宏观层面自上而下的分析,把握宏观经济基本态势和市场利率波动趋势,及时调整组合的平均剩余期限,使基金资产获得稳定的较高收益。

本基金构建债券组合时,将具体采取利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、替代互换选择策略和骑乘策略等积极投资策略,发现、确认并利用市场中存在的机会,实现组合稳定增值。同时,将根据组合流动性情况调整个券投资,保证核心债券组合的流动性。为了严格控制投资风险,本基金将谨慎地投资信用等级为投资级的企业(公司)债。

(1)利率预期策略

该策略是基于对未来利率走势的预测,改变组合平均剩余期限,以适应利率变化。本策略主要是基于宏观经济环境的深入研究,预期未来市场利率的变化趋势,结合基金未来现金流的分析,确定投资组合平均剩余期限。如果预测未来利率将上升,则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险,相反,如果预测未来利率下降,则延长组合平均剩余期限,赚取利率下降带来的超额回报。

(2)收益率曲线策略

该策略是通过市场收益率曲线形状的变化来调整组合结构的策略,具体包括子弹策略、两极策略和梯式策略三种。按子弹策略构建的投资组合目的是为了使组合中证券的到期集中在收益率曲线的一点;两极策略则是将证券的到期期限集中于两极;梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。

(3)收益率利差策略

该策略是基于不同债券市场板块间利差而在组合中分配资本的方法。收益率利差包括信用利差、可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差等表现形式。信用利差存在于不同债券市场,如国债和企业债利差、国债与金融债利差、金融债和企业债利差等;可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差形成的原因是基于利率预期的变动。

(4)替代互换选择策略

这是以一种息票利率、期限、信用质量都相同,但收益率要略高的债券来更换组合中的债券。这种互换依赖于资本市场的不完善,这种情况的出现一般存在暂时性。

(5)骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平相对较高的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度,如果收益率曲线较为陡峭,则骑乘策略运用的可行性就增大,该策略的运用可以获得较高的资本利得;反之,如果收益率曲线比较平坦,则骑乘策略运用的空间就较窄,获得资本利得的可能性降低。

3、可转换债券投资策略

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,并有利于认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,以获取更高的投资收益。

4、资产支持证券投资策略

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积极策略,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。

5、新股申购投资策略

参照目前国内其他金融品种的投资收益,我们认为参与新股投资将是最具有低风险、高收益的投资品种之一。同时,随着股改完成,预计我国证券市场在未来仍将保持一定数量与规模的新股发行。本基金作为固定收益类产品,将在充分依靠公司研究平台和股票估值体系、深入发掘新股内在价值的前提下,积极参与新股的申购。

九、基金的业绩比较基准

中国债券总指数。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

将来如有更合适的指数推出,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种,其预期的风险水平和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

1.重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2010年5月10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2010年3月31日。

2. 基金投资组合报告

2.1 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	106,658,796.52	15.84
	其中:股票	106,658,796.52	15.84
2	固定收益投资	509,882,163.30	75.70
	其中:债券	509,882,163.30	75.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	44,403,316.28	6.59
6	其他资产	12,615,408.52	1.87
7	合计	673,559,684.62	100.00

2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	27,786,489.92	4.56
B	采掘业	1,026,998.00	0.17
C	制造业	70,911,965.40	11.63
C0	食品、饮料	405,940.36	0.07
C1	纺织、服装、皮毛	639,357.60	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,585,903.14	0.26
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,680.00	0.00
C5	电子	1,350,926.55	0.22
C6	金属、非金属	289,074.90	0.05
C7	机械、设备、仪表	62,478,611.83	10.25
C8	医药、生物制品	4,154,471.02	0.68
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,933,343.20	1.14
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	106,658,796.52	17.49

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	601106	中国一重	10,207,553	54,916,635.14	9.01
2	600598	北大荒	2,019,367	27,786,489.92	4.56
3	002335	科华恒盛	45,882	2,170,218.60	0.36
4	002332	仙琚制药	97,604	1,747,111.60	0.29
5	002348	高乐股份	66,162	1,585,903.14	0.26
6	002338	奥普光电	31,583	1,559,568.54	0.26
7	300033	同花顺	26,168	1,447,090.40	0.24
8	002351	漫步者	33,731	1,350,926.55	0.22
9	300047	天源迪科	40,479	1,350,379.44	0.22
10	002331	皖通科技	26,748	1,225,860.84	0.20

2.4 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	国家债券	84,326,800.00	13.83
2	央行票据	81,888,000.00	13.43
3	金融债券	30,330,000.00	4.97
	其中:政策性金融债	30,330,000.00	4.97
4	企业债券	234,569,300.10	38.46
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	78,768,063.20	12.92
7	其他	-	-
8	合计	509,882,163.30	83.61

2.5 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

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	0801023	08央票23	800,000	81,888,000.00	13.43
2	110006	龙盛转债	293,880	42,915,296.40	7.04
3	010110	21国债(10)	380,000	38,725,800.00	6.35
4	122981	09铜陵投	326,690	33,306,045.50	5.46
5	088015	08甬交投	300,000	32,328,000.00	5.30

2.6 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。

2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

2.8 投资组合报告附注

2.8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

2.8.2 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。

2.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,478.49
2	应收证券清算款	3,715,620.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,824,359.81
5	应收申购款	1,062,950.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,615,408.52

2.8.4 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	110006	龙盛转债	42,915,296.40	7.04
2	125969	安泰转债	22,265,600.00	3.65
	110005	西洋转债	13,587,166.80	2.23

2.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601106	中国一重	54,916,635.14	9.01	新股网下认购
2	002335	科华恒盛	2,170,218.60	0.36	新股网下认购
3	002332	仙琚制药	1,747,111.60	0.29	新股网下认购
4	002348	高乐股份	1,585,903.14	0.26	新股网下认购
5	002338	奥普光电	1,559,568.54	0.26	新股网下认购
6	002351	漫步者	1,350,926.55	0.22	新股网下认购
7	300047	天源迪科	1,350,379.44	0.22	新股网下认购
8	002331	皖通科技	1,225,860.84	0.20	新股网下认购

十二、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。

(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

截止时间2009年12月31日)

1、华安收益A类基金:

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
2009年	3.79%	0.29%	-1.24%	0.10%	5.03%	0.19%
自基金合同生效日(2008年4月30日)起至2008年12月31日	9.53%	0.15%	11.25%	0.24%	-1.72%	-0.09%

2、华安收益B类基金:

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
2009年	3.33%	0.29%	-1.24%	0.10%	4.57%	0.19%
自基金合同生效日(2008年4月30日)起至2008年12月31日	9.21%	0.15%	11.25%	0.24%	-2.04%	-0.09%

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、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.6%

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,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,经基金托管人复核后于次月首日起3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年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.2%

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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,B类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日B类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的A类基金份额在申购时收取申购费,B类基金份额在申购时不收取申购费。

A类基金份额收费模式下

(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。本基金最高申购费率不超过0.8%,投资人在一天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:

申请金额(M)	费率
M<100万	0.80%
100万≤M<500万	0.50%
500万≤M<1000万	0.30%
M≥1000万	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	1.00%
1年≤Y<2年	0.80%
2年≤Y<3年	0.60%
3年≤Y<4年	0.40%
4年≤Y<5年	0.20%
Y≥5年	0.00

注:一年指365天,两年为730天,依此类推。

B类基金份额收费模式下

具体费率如下:

申请金额(M)	费率
全部	0.00%

本基金的申购费用由投资人承担并应在投资人申购基金份额时收取,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费

本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.3%,按持有期递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在投资者赎回基金份额时收取。其中,须依法扣除所收取的赎回费总额的25%归入基金财产,其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。具体费率如下:

费用种类	赎回费率(持有期限Y)	
A类基金份额	Y<30天	0.3%
	30天≤Y<1年	0.1%
	1年≤Y<2年	0.05%
	Y≥2年	0%
B类基金份额	Y<30天	0.3%
	Y≥30天	0%

注:一年指365天,两年为730天,依此类推。

3、转换费

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

转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

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

注1: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、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、基金合同生效后与基金有关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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定;由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用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率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,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》、《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,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

费用种类	主要更新内容
三、基金管理人	更新了"(一)基金管理人概况"和"(三)主要人员情况"。
四、基金托管人	更新了基金托管人相关信息。
五、相关服务机构	对部分直销机构和代销机构信息进行了更新。
八、基金份额的申购、赎回与转换	对"(一)日常申购、赎回与转换的场所"中部分直/代销机构进行了更新;对"(五)日常申购、赎回与转换的数额和价格"中部分内容进行了更新;
九、基金的投资	更新了最近一期基金投资组合报告。
十、基金的业绩	对基金合同生效以来的业绩进行了更新。
二十一、对基金份额持有人的服务	对"(六)基金电子交易服务"、"(十一)资讯服务"进行了更新。
二十二、其他应披露事项	披露了自2009年10月30日至2010年4月30日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司

二〇一〇年六月十一日

股票简称:海马股份　　股票代码:000572　　编号:2010-23

海马投资集团股份有限公司董事会七届十次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

海马投资集团股份有限公司董事会七届十次会议于2010年6月7日以电话及电子邮件方式发出会议通知,于6月10日以通讯方式召开。应参加表决的董事8人,实际参加表决的董事8人。符合公司法及公司章程的规定。公司董事会通过了以下议案:

一、以8票赞成,0票反对,0票弃权,通过了《关于调整公司非公开发行股票方案的议案》,并将该议案提交公司2010年第一次临时股东大会审议。

公司向特定对象非公开发行股票方案的议案已经公司董事会七届五次会议及公司2009年度股东大会审议并通过。(详见2010年1月27日、3月18日《证券时报》和巨潮资讯网)。根据近期国内A股市场的实际情况,拟调整非公开发行股票的发行价格及发行数量以利于完成本次非公开发行。公司据此调整了《海马投资集团股份有限公司非公开发行股票预案》。(详见同日刊登于巨潮资讯网的《海马投资集团股份有限公司非公开发行股票预案(修正案)》)

1、定价基准日

本次非公开发行股票的定价基准日为公司第七届董事会第十次会议决议公告日(2010年6月11日)。

2、定价方式或价格区间

发行价格不低于定价基准日前20个交易日公司股票交易均价的90%(定价基准日前20个交易日股票交易均价=定价基准日前20个交易日股票交易总额/定价基准日前20个交易日股票交易总量),即不低于4.97元/股。具体发行价格将在取得发行核准批文后,由公司董事会根据股东大会的授权,并根据发行对象申购报价的情况,遵照价格优先原则,与本次发行的保荐机构(主承销商)协商确定。

如本公司股票在本次发行定价基准日至发行日期间发生除权、除息事项,发行底价将做出相应调整。

3、发行数量

本次非公开发行股票数量为不超过61,000万股。在上述范围内,由董事会根据股东大会的授权并结合发行情况与保荐机构(主承销商)协商确定最终发行数量。若本公司股票在定价基准日至发行日期间发生除权、除息事项,本次发行数量将做出相应调整。

4、本次非公开发行股票决议的有效期限

本次非公开发行股票决议的有效期