(上接D39版)

注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号
法定代表人:邵林
电话:021)32229888
传真:021)62878701
客户服务电话:021)63340678
网址:www.ajzq.com

(96)英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十层、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
电话:0755)83007041/ 83007166
传真:0755)83007034
客户服务电话:4008-698-698.0755-26982993
网址:www.ydsc.com.cn

(97)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:丁之锁
电话:010)58568007
传真:010)58568062
客户服务电话:010)58568162
网址:www.hrsec.com.cn

(98)财达证券股份有限公司
注册地址:河北省石家庄市自强路35号
办公地址:石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
法定代表人:翟建强
电话:0311)86028442
传真:0311)86006244
客户服务电话:4006128888
网址:www.s10000.com

(99)天风证券有限责任公司
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
办公地址: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
法定代表人:余磊
电话:027)87618889
传真:027)87618863
客户服务电话:027)87618882/ 028)86711410.028-86712334
网址:www.tfzq.com

(100)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:李学隆
电话:024)23266917
传真:024)23255606
客户服务电话:4006180315
网址:www.stock.cn.com

(101)大通证券股份有限公司
注册地址:大连市中山区人民路24号
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人:张智河
电话:0411)39673301
传真:0411)39673219
客户服务电话:4008-169-169
网址:www.estock.com.cn

(102)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5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
电话:010)66045608
传真:010)66045500
客户服务电话:010)66045678
网址:www.txsec.com/ jijin.txsec.com

(103)财富里昂证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
法定代表人:罗浩
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:68777877.021-38784818
公司网站:www.cf-clsa.com

(104)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州杭大路15 号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州杭大路15 号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
客服电话:0571-96336(浙江),40086-96336(全国)
网址:www.ctsec.com
(二)基金注册与过户登记人
名称:华安基金管理有限公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道8号,上海国金中心二期31、32层
法定代表人:李勋
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
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有限公司
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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
电话:021)23238888
传真:021)23238800
联系人:金毅
经办注册会计师:马颖妮、金毅

六、基金的名称

本基金名称:华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金。

七、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

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股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。

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.投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%,本基金投资MSCI中国A股指数成份股的比重在50个交易日内不持续低于组合中股票市值的80%。
2.参与股票一级市场的市值配售以及MSCI中国A股指数成份股的增发和配股。
3.在成份股之外的股票投资,仅限于未售出的申购新股、预期持调整入指数成份股的个股以及增强性投资中替代成份股的其他个股。
4.在目前的法律法规限制下,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。
5.经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。

十、基金的投资决策

(一)投资策略
1.投资组合原则及选择标准
①)投资组合的基本原则
1)资产分配原则:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。
2)股票投资原则:本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪误差,适时对投资组合进行调整,使跟踪误差控制在限定的范围内。此外,本基金还将参与一级市场的新股申购、股票增发等。
3)其他投资原则:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。
②)投资组合构建
1)股票指数化投资组合构建:
本基金的指数化投资方式将采用复制法来实现对MSCI中国A股指数的跟踪,具体过程如下:
①)以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重为基础拟定标准权重的指数化投资组合方案;
②)根据增强性投资选择标准,对标准权重的指数化投资组合进行调整,形成指数增强型投资组合方案;
③)根据拟定的指数增强型投资组合方案,通过指数化投资组合交易系统进行买卖;
④)基金经理根据建仓过程中的买卖情况、申购赎回情况等,对投资组合进行动态调整,以保证完成指数化投资组合的构建。
2)增强性投资选择标准:
本基金的增强性投资,是指在基于研究员和基金经理对行业及上市公司的深入研究和调查的基础上,由基金经理根据股票市场的具体情况,对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整。对于以下成份股,本基金将考虑予以剔除或降低权重:
①)由于公司经营状况、财务状况严重恶化或其他基本面发生重大变化而导致其投资价值严重降低的个股;
②)因流动性太差而导致无法按照指数标准权重建仓的个股;
③)存在重大违规嫌疑,被监管部门调查的个股;
④)基金经理在充分调研的基础上,判断预期收益将远低于成份股中同类股票或指数平均水平的个股;
⑤)其他特殊个股,例如预期将从指数中剔除的个股等。
对于以下个股,本基金将考虑纳入组合或增加投资权重:
①)新股配售而得到的非成份股以及因增发配售而超出指数标准权重的成份股,本基金将在新股上市后1个月以内择机卖出此类股票;
②)由于其他成份股的建仓困难而被选择作为替代的个股;
③)基金经理在充分调研的基础上,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。
(3)指数化增强性投资管理的限度和控制
本基金以指数化投资为主,增强性投资为辅,为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离,本基金将日均跟踪误差最大容忍值设定为0.5%,如该指标接近或超过0.5%,(相应折算的年化跟踪误差约为7.75%),则基金经理必须通过归因分析,找出造成跟踪误差的来源,如是源于积极投资的操作,则在适当时机行使必要的组合调整,降低增强性投资力度,以使跟踪误差回归到最大容忍值以下。当本基金运作发展到一定阶段后,本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪误差,具体变化将另行公告。
除此之外,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股指数成份股的数量不低于指数成份股总个数的70%;
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%;
2.投资管理的基本程序
(1)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分配比例和行业权重相对指数的偏离度作出检讨和决议;
2)金融工程小组利用集成市场预测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,研究部门从基本面分析对行业、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、赎回的动态情况,供基金经理参考;
3)基金经理小组根据对以上因素的判断,初步决定投资组合,包括股票、现金以及其他投资品种的比例、行业、个股和整体投资组合相对指数的偏离度,以及新股配售等一级市场操作的参与力度;
4)基金经理小组根据交易情况的反馈报告,对组合进行适度调整,对于需调整的个股,研究部事先提供备选的其他股票;
5)风险分析小组对基金投资组合偏离风险进行评估,并提出偏离的归因分析报告,在组合日均跟踪误差超过0.5%时提出预警;
6)监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。
(2)投资操作程序
1)基金经理根据指数的标准构成,在设定的调整范围内定出组合中各个股票的比例关系,输入交易系统;
2)需买入股票时,交易员启动组合交易系统,系统按事先设定的个股权重统一下单买入,需卖出股票时,系统统一下单卖出;
3)对于需调整成组合交易出现困难的个股,基金经理可独立发出指令,交易员可在交易时间内进行单个品种操作;
4)投资部定期对指数化投资组合进行跟踪误差的测算,若跟踪误差超过允许的范围,则对组合进行调整;
5)当发生新股申购和MSCI中国A股指数成份股的增发时,研究部提供拟发行新股企业和增发企业的研究报告;投资部根据研究报告进行新股申购和增发;
6)本基金建仓期为3个月。
(二)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。
本基金投资组合应遵循下列规定:
(1)本基金持有1家上市公司的股票,其市值不超过本基金资产净值的10%,但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外;
(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有1家公司发行的证券的总和,不超过该证券的10%,但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外;
(3)法律法规和中国证监会的其他比例限制。
禁止用本基金资产从事以下行为:
(1)投资于其他证券投资基金;
(2)以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;
(3)以基金资产进行房地产投资;
(4)从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
(5)将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券;
(6)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。

十一、基金的业绩比较基准

本基金采用由权威机构发布的、代表中国A股市场的成份指数作为衡量基金投资操作水平的比较基准,目前这一指数为MSCI中国A股指数。衡量本基金整体业绩的比较基准为:
本基金整体业绩比较基准 = 95% * MSCI中国A股指数收益率+ 5% * 金融同业存款利率
如果MSCI公司变更或停止MSCI中国A股指数的编制及发布,或MSCI中国A股指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致MSCI中国A股指数不宜继续作为标的指数时,本基金管理人有权依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数并相应变更本基金的名称。

十二、基金的风险收益特征

本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场的平均回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。

十三、基金的投资组合报告

(一)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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月13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2012年3月31日。
(二)基金投资组合报告
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	4,363,491,253.07	94.07
	其中:股票	4,363,491,253.07	94.07
2	固定收益投资	154,896,000.00	3.34
	其中:债券	154,896,000.00	3.34
	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	79,726,929.23	1.72
6	其他各项资产	40,552,247.38	0.87
7	合计	4,638,666,429.68	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,663,975.32	0.06
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,663,975.32	0.06
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
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	-	-
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	2,663,975.32	0.06

2.2 指数投资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	45,361,818.05	0.98
B	采掘业	411,401,220.10	8.90
C	制造业	1,784,846,054.15	38.61
C0	食品、饮料	335,533,318.92	7.26
C1	纺织、服装、皮毛	27,307,930.90	0.59
C2	木材、家具	3,981,327.83	0.09
C3	造纸、印刷	7,042,713.44	0.15
C4	石油、化学、塑胶、塑料	114,252,635.42	2.47
C5	电子	84,992,931.68	1.84
C6	金属、非金属	332,363,851.83	7.19
C7	机械、设备、仪表	568,216,594.66	12.29
C8	医药、生物制品	308,181,838.27	6.67
C99	其他制造业	2,972,911.20	0.06
D	电力、煤气及水的生产和供应业	81,127,210.17	1.75
E	建筑业	118,970,588.23	2.57
F	交通运输、仓储业	142,815,754.13	3.09
G	信息技术业	146,966,034.29	3.18
H	批发和零售贸易	136,311,453.85	2.95
I	金融、保险业	1,001,432,140.57	21.66
J	房地产业	280,587,485.09	6.07
K	社会服务业	85,786,886.45	1.86
L	传播与文化产业	37,694,138.59	0.82
M	综合类	87,526,494.08	1.89
	合计	4,360,827,277.75	94.34

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
3.1期末指数投资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	600036	招商银行	10,556,352	125,620,588.80	2.72
2	600016	民生银行	19,229,025	120,565,986.75	2.61
3	601166	兴业银行	8,392,442	111,787,327.44	2.42
4	000858	五粮液	2,407,578	79,064,861.52	1.71
5	600837	海通证券	8,751,375	78,849,888.75	1.71
6	600519	贵州茅台	352,533	69,434,899.68	1.50
7	600048	保利地产	6,055,717	68,369,044.93	1.48
8	600030	中信证券	5,723,391	66,334,101.69	1.43
9	601088	中国神华	2,548,414	65,264,882.54	1.41
10	600000	浦发银行	7,202,123	64,314,958.39	1.39

3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000677	ST海龙	581,654	2,663,975.32	0.06

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	-	-
2	央行票据	154,896,000.00	3.35
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	154,896,000.00	3.35

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	1101022	11央票22	1,600,000	154,896,000.00	3.35

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。
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。
8 投资组合报告附注
8.1 2011年5月27日,五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》,本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。报告期内,基金投资的前十名其他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。
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。
8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	806,860.92
2	应收证券清算款	5,832,850.66
3	应收股利	101,500.67
4	应收利息	4,975,234.64
5	应收申购款	28,835,800.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,552,247.38

8.4 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。
8.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票未出现流通受限情况。
8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五名股票未出现流通受限情况。

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2012年12月31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
2011-1-1至2011-12-31	-25.64%	1.25%	-25.76%	1.25%	0.12%	0.00%
2010-1-1至2010-12-31	-6.65%	1.49%	-8.18%	1.49%	1.53%	0.00%
2009-1-1至2009-12-31	85.11%	1.87%	90.27%	1.92%	-5.16%	-0.05%
2008-1-1至2008-12-31	-62.45%	2.81%	-61.41%	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	-0.56%	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%	8.17%	0.86%	3.29%	-0.01%
2002-11-8至2002-12-31	-1.70%	0.23%	-8.76%	0.92%	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)基金管理人的管理费
基金管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 1% ÷ 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0.2%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.2% ÷ 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)证券交易费用
(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其他有关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
本基金提供两种申购费用的支付模式,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,投资者可选择前端收费或后端收费模式。
(1)前端收费模式的申购费按申购金额采用比例费率,申购费率如下(值销机构、电子交易平台除外):

收费模式	单笔申购金额	申购费率
前端申购费	M≥1000万	每笔1000元
	100万≤M<1000万	1.20%
	M<100万	1.50%

(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	后端申购费率(持有期限Y)	
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<4年	1.00%
	4年≤Y<5年	0.50%
	Y≥5年	0

注:一年指365天,两年为730天,依此类推。
本基金的申购费用由投资人承担并根据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
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))×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))×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,由此产生的误差记入基金资产。
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)证券交易费用
(2)基金信息披露费用
(3)基金份额持有人大会费用
(4)与基金相关的会计师费和律师费
(5)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(5)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。
(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。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。
(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》、《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:

章节	主要更新内容
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。
五、相关服务机构	更新了部分直销机构和代销机构的信息; 更新了注册登记机构相关信息。
六、基金份额的申购、赎回与转换	对"(二)日常申购、赎回与转换的场所"中部分直销和代销机构信息进行了更新。
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	更新全部内容。
二十二、其他应披露事项	披露了自2011年11月8日至2012年5月8日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一二年六月二十一日

(上接D38版)

(80)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
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
客户服务电话:0931-4890619 4890618 4890100
网址:http://www.hlzqgs.com/

(81)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
联系人:王雪莉
电话:010-65051166
传真:010-65051156
客户服务电话:010)85679239转6179;0755)83195000;021)63861195;63861196
网址:http://www.cicc.com.cn/

(82)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室
法定代表人:沈继宁
联系人:徐轶青
电话:0571-87822359
传真:0571-87925100
客户服务电话:96336(上海地区962336)
网址:http://www.ctsec.com

(83)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49楼
法定代表人:高竹
联系人:赖君伟
电话:0755-23902400
传真:0755-82545500
客户服务电话:4001840028
网址:http://www.wkzq.com.cn

(84)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01、b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01、b)单元
法定代表人:洪家新
联系人:孔泉
电话:021-64376245
传真:021-64333051
客户服务电话:021-32109999.029-68918888
网址:http://www.cfsc.com.cn

(85)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
办公地址: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
联系人:牟冲
电话:010-5832 8112
传真:010-5832 8748
客户服务电话:4008878827
网址:http://www.ubssecurities.com

(86)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客户服务电话:4006008008
网址:http://www.cjis.cn/

(87)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴泳良
联系人:李玲
电话:0755-82943755
传真:0755-82940511
客户服务电话:4001022011
网址:http://www.zszq.com.cn

(88)信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈韦杉
电话:010-88086830
传真:010-66412537
客户服务电话:010-66413306
网址:http://www.rxzq.com.cn

(89)江海证券有限公司
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
联系人:张宇宏
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
网址:http://www.jhzq.com.cn

(90)天源证券经纪有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:裴东平
联系人:关键
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
客户服务电话:4006543218
网址:http://www.tyzq.com.cn

(91)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
联系人:袁月
电话:0755-36659385
传真:021-68777822
客户服务电话:4008209898;021-38929908
网址:http://www.cnhbstock.com

(92)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文
电话:0592-5161816
传真:0592-5161102
客户服务电话:0592-5163588
网址:http://www.xmzq.cn

(93)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:郭林
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-68728703
客户服务电话:021-63340678
网址:http://www.ajzq.com

(94)英大证券有限责任公司
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三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:刘晓章
电话:0755-83007190
传真:0755-83007167
客户服务电话:0755-26982993
网址:http://www.ydsc.com.cn

(95)财达证券有限责任公司
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23至26层
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23至26层
法定代表人:翟建强
联系人:刘亚静
电话:0311-66006393
传真:0311-66006249
客户服务电话:4006128888
网址:http://www.S10000.com

(96)大通证券股份有限公司
注册地址:辽宁省大连市中山区人民路24号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人:于宏民
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
客户服务电话:4008169169
网址:http://www.dalton.com.cn
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(三)注册登记机构
名称:博时基金管理有限公司
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址:北京市东城区建国门内大街8号中粮广场A座5层
法定代表人:杨鹤
电话:(010)65171166
传真:(010)65187068
联系人:许鹏
(四)律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬
(五)会计师事务所和经办注册会计师
机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址: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
法人代表:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:张鸿
经办注册会计师:汪棣、张鸿
四、基金的名称
博时回报灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
为投资者的资产实现保值增值、提供全面超越通货膨胀的收益回报。
七、投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。
本基金投资组合中股票等权益类证券投资比例为基金资产的30%—80%,其中权证投资比例不得超过基金资产净值的3%;固定收益类证券(包括货币市场金融工具)的投资比例不低于基金资产的20%,固定收益类证券(包括货币市场金融工具)主要包括国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、央票、回购(包括正回购和逆回购)、可转换债券、资产证券化产品等;现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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、投资策略
本基金具体投资策略分三个层次:首先是大类资产的配置,即根据经济周期决定股票等权益类证券和债券等固定收益类证券的投资比例;其次是行业配置,即根据通胀通缩变化和经济发展的内在逻辑,在通胀通缩的不同阶段,配置不同的行业;最后是个股选择策略和债券、权证、股指期货等资产的投资策略。
1.资产配置策略
本基金将通过综合观察流动性指标、产出类指标和价格类指标来预测判断流动性变化方向、资产价格水平的变化趋势和所处阶段,提前布局,进行