(上接B38版)

电话:(010)83561149
传真:(010)83561094
客户服务电话:400-698-9898?
网址:www.xsdzq.cn
(59)国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
电话:(0510)82831662
传真:(0510)82830162
客户服务电话:(0510)82588168
网址:www.glsc.com.cn
(60)浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6/7楼
法定代表人:吴承根
电话:(0571)87901053
传真:(0571)87901913
客户服务电话:967777
网址:www.stocke.com.cn
(61)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
电话:4008866338
传真:(0755)82400862
客户服务电话:95511-8
网址:www.stock.pingan.com
(62)华安证券股份有限公司
注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:李工
电话:(0551)5161666
传真:(0551)5161600
客户服务电话:96518
网址:www.hazq.com
(63)国海证券有限责任公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
法定代表人:张雅锋
电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
客户服务电话:(0771)5539032
网址:www.ghzq.com.cn
(64)财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人:周晖
电话:(0731)4403343
传真:(0731)4403439
客户服务电话:0731-84403304
网址:www.cfzq.com
(65)东莞证券有限责任公司
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人:张运勇
电话:(0769)22119351
传真:(0769)22119423
客户服务电话:0769-961130
网址:www.dgzq.com.cn
(66)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
电话:(0371)65585670
传真:(0371)65585665
客户服务电话:(0371)967218
网址:www.ccnew.com
(67)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
电话:(010)84183389
传真:(010)64482090
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
(68)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、19号楼
法定代表人:朱科敏
电话:(021)50586660-8636
传真:(021)50586660-8611
客户服务电话:4008888588
网址:www.longone.com.cn
(69)中银国际证券有限责任公司
地址:中国上海浦东银城中路200号中银大厦39层
电话:(021)68604866
传真:(021)58883554
客户服务电话:021-4006208888
网址:www.bocichina.com
(70)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
电话:(0471)4913998
传真:(0471)4930707
客户服务电话:(0471)4961259
网址:www.cnht.com.cn
(71)国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人:曾小普
电话:(0791)6289771
传真:(0791)6289395
网址:www.gsstock.com
(72)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
法定代表人:冯戎
联系电话:(010)88085858
传真号码:(010)88085195
客户服务电话:0991-400-800-0562
公司网址:www.hysec.com
(73)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
传真:(0531)68889752
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
(74)世纪证券有限责任公司
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:卢长才
电话:(0755)83199511
传真:(0755)83199545
客户服务电话:(0755)83199509
公司网站:www.csco.com.cn
(75)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号
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号
法定代表人:刘学民
电话:(0755)25832583
传真:(0755)25831718
客户服务电话:4008881888
网址:www.firstcapital.com.cn
(76)中航证券有限公司
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
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栋41层
法定代表人:杜航
电话:(0791)6768763
传真:(0791)6789414
客户服务电话:4008866567
网址:www.avicsec.com
(77)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市曹杨路510号南半幢9楼
法定代表人:姚文平
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客户服务电话:4008888128
网址:www.tebon.com.cn
(78)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东新街232号信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:(029)87406172
客户服务电话:95582
网址:www.westsecu.com.cn
(79)华福证券有限责任公司
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
法定代表人:黄金琳
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
客户服务电话:(0591)96326
网址:www.hfzq.com.cn
(80)华龙证券有限责任公司
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
法定代表人:李晓安
电话:(0931)4890100
传真:(0931)4890118
客户服务电话:(0931)4890619
网址:www.hlzqgs.com
(81)中国国际金融有限公司
注册地址: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
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
(82)瑞银证券有限责任公司
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
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
(83)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18-21层
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
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话 0755-82023442
传真 0755-82026539
网址 www.cjis.cn
客服电话 400 600 8008
(84)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
法定代表人:吴永良
电话:(0755)82943755
传真:(0755)82940511
客户服务电话:4001022011
网址:www.zszq.com.cn
(85)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
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
法定代表人:况雨林
电话:(0871)3577930
传真:(0871)3578827
客户服务电话:(0871)3577930
网址:www.hongtazq.com
(86)日信证券有限责任公司
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
法定代表人:孔佑杰
电话:(0471)6292587
传真:(0471)6292477
网址:www.rxzq.com.cn
(87)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
电话:(0451)82336863
传真:(0451)82287211
客户服务电话:40066-62288
网址:www.jhzq.com.cn
(88)华宝证券有限责任公司
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
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
(89)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:(0952)5161642
传真:(0952)5161140
客户服务电话:(0952)5163588
网址:www.xmzq.cn
(90)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市世纪大道1600号32楼
办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:郭林
电话:(021)32229888
传真:(021)62878701
客户服务电话:(021)63340678
网址:www.ajzq.com
(91)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
电话:(0755)83007041/83007166
传真:(0755)83007034
客户服务电话:(0755)26982993
网址:www.ydsc.com.cn
(92)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:宋德清
电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客户服务电话:(010)58568162
网址:www.hrsec.com.cn
(93)财达证券股份有限公司
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24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24层
法定代表人:翟建强
电话:(0311)86028442
传真:(0311)66006244
客户服务电话:4006128888
网址:www.s10000.com
(94)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:武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座四楼
法定代表人:余磊
电话:(027)87618889
传真:(027)87618863
客户服务电话:(028)86712334
网址:www.tfzq.com
(95)中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马功勋
电话:(024)23266917
传真:(024)23255606
客户服务电话:4006180315
网址:www.stockren.com
(96)大通证券股份有限公司
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-大连期货大厦
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
(97)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
(98)财富里昂证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心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
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:021-38784818
公司网站:www.cf-clsa.com
(99)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
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
客服电话:0571-96336
网址:www.ctsec.com
(100)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:400-700-9665
传真:021-68596916
网址:www.ehowbuy.com
(101)上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
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
法定代表人:其实
电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn
(102)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
法定代表人:陈柏青
电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
(103)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室
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
法定代表人:张跃伟
电话:021-58788678
网址:www.e-rich.com.cn
(二)注册登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层
法定代表人:李勍
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
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
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办会计师:汪棣、庄贤

四、基金的名称

本基金名称:华安行业轮动股票型证券投资基金。

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

本基金注重把握行业轮动规律,力求通过行业优化配置,对强势行业的龙头企业和具有估值优势、成长潜力的股票进行重点投资,获取超额收益,实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%~95%;债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为5~40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为0~3%,现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法优化行业配置,构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的多因子模型等数量工具进行支持,使其更为科学和客观。

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,利用公司研究开发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等数量工具,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,估计各子资产类的相关性矩阵,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。本基金的股票投资比例为基金资产净值的60%-95%。

2、股票投资策略

本基金的股票资产投资采取行业轮动策略。所谓行业轮动投资策略是指,在宏观分析和个股选择的基础上强调行业的动态优化配置。通过超配不同时期的相对强势行业,获得超越市场平均水平的收益。

(1)行业配置

本基金将基于GICS二级行业分类标准,采用自上而下和自下而上相结合的行业配置方法构建投资组合。所谓自上而下的行业配置是指,通过深入分析宏观经济指标和不同行业自身的周期变化以及在国民经济中所处的位置,确定本基金重点投资的行业,并对行业发展进行预测,以期把握今后一段时间内行业轮动的特征。所谓自下而上的行业配置是指,从上市公司的业绩、估值和市场表现出发,寻找行业中的轮动规律。

本基金采用基本面分析与定量分析相结合的方法,把握以下几种类型的行业轮动周期。

■估值回复型行业轮动。本基金将利用分类行业模型和公司有关研究部门的分析结果提供决策支持,动态地建立起一个包含所有行业的评估系统,数量化地分析各行业与整体经济变动的相关性及各行业自身的周期性,判断和预测行业的相对价值,以及不同行业之间的估值水平差异。A股市场的历史显现出了低估值效应的存在,因此如果追求长期的轮动效果,选择绝对估值或者相对估值较低的行业进行超配是一种不错的选择。

■业绩驱动型行业轮动。行业内个股的基本面信息仍然是决定行业整体表现的重要因素。基金经理根据EPS增长率、ROE等公司财务指标和研究部门提供的公司基本面信息对行业整体的景气程度和业绩表现进行总体把握,识别不同时期的强势行业,把握业绩驱动下的行业轮动特征。

■动量反转型行业轮动。尽管A股市场在个股层面不存在显著的动量效应和反转效应,但根据历史数据的实证分析却发现,行业层面在一个月的周期内表现出显著的动量效应,即前期收益率较高的行业组合在一个月内继续表现强劲。行业层面在六个月的周期内表现出显著的反转效应,即前期收益率高的行业组合在六个月后开始走弱。基金经理可根据金融工程部对动量组合和反转组合的测算,把握动量和反转型行业轮动。

(2)个股选择

本基金股票资产以A股市场基本面良好的上市公司为投资对象,基金经理将基于行业配置的要求,对A股市场的股票进行分类和筛选,选择各行业龙头企业和价值被低估的企业作为重点关注对象。对重点公司建立财务模型,预测其未来几年的经营情况和财务状况,在此基础上对公司股票进行估值,以决定是否纳入本基金的投资范围。

■行业龙头企业。行业龙头企业,一般指在该行业里股本、市值、规模、市场占有率居前的代表性企业。这些企业由于规模巨大,市场占有率高,所以其自身发展对全行业有重大影响,往往引领全行业的发展方向和兴衰。

■成长性企业。成长性企业是指那些在较长时期内,具有持续挖掘未利用资源的能力、不同程度地表现出整体扩张的态势、未来发展预期良好的企业。成长型企业具有高增长性、企业活力和适应性、稳定性的特点,该类企业能够为投资者带来可预期收益。

■价值低估企业。基金经理充分利用华安开发的各类股票估价模型和研究部门的研究分析结果,考察影响市场和股票价格变动的诸多因素,综合判断企业的内在价值。如果企业股票的市场价格因为某种原因没能反映其真实价值或潜在价值,则视为价值低估企业。

(3)组合构建

在组合构建的过程中,基金经理着重行业的优化配置,对以下几个方面加以考虑:

■行业间的相关性矩阵。基金经理通过行业间的相关性矩阵分析,在超配强势行业的同时尽可能降低组合风险。

■买卖时机和操作周期。基金经理根据数量分析小组的模型分析和自身判断,把握合适的市场时机和行业的周期性拐点,在预期的操作周期内完成投资组合的构建。

3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分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,构造债券组合。

在选择国债品种中,本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合;在选择金融债、企业债品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例,捕捉其套利机会。4、权证投资策略

本基金在实现权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较为稳定的收益。

5、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。

6、其他衍生工具投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,一旦有新的产品推出市场,将在届时相应法律法规的框架内,制订符合本基金投资目标的投资策略,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。

7、基金建仓期

本基金的建仓期不超过6个月。

(二)投资限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

(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与基金管理人、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;

(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;

(8)依照法律、行政法规有关法律法规规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(2)本基金持有一家公司发行的债券不超过基金资产净值的10%;

(3)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;

(4)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(6)现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(11)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(12)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

(13)相关法律法规以及监管部门规定的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(三)基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

九、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准=80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率

沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,具有权威性,适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

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。

如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出,或有更科学客观的权重比例适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和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

本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种。

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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2013年3月31日。

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	574,404,887.72	90.50
	其中:股票	574,404,887.72	90.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	52,988,913.41	8.35
7	其他各项资产	7,326,217.57	1.15
8	合计	634,720,018.70	100.00

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	-	-
B	采矿业	9,154,581.28	1.47
C	制造业	293,620,269.97	47.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,579,495.56	1.38
E	建筑业	23,132,466.06	3.72
F	批发和零售业	33,789,406.56	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	31,132,050.82	5.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,698,203.75	5.26
J	金融业	29,239,000.00	4.70
K	房地产业	98,534,413.72	15.84
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	14,525,000.00	2.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	574,404,887.72	92.35

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	601318	中国平安	700,000	29,239,000.00	4.70
2	600519	贵州茅台	150,000	25,329,000.00	4.07
3	300322	硕贝德	1,000,000	25,300,000.00	4.07
4	600383	金地集团	3,500,000	22,995,000.00	3.70
5	600660	福耀玻璃	2,798,721	22,697,627.31	3.65
6	600208	新湖中宝	6,999,909	22,679,705.16	3.65
7	601111	中国国航	3,600,002	20,016,011.12	3.22
8	300136	信维通信	902,399	17,759,212.32	2.86
9	600050	中国联通	5,000,000	17,650,000.00	2.84
10	000002	万 科A	1,500,000	16,140,000.00	2.59

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1 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。

8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

9 投资组合报告附注

9.1 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。

9.2 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。

9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	207,550.89
2	应收证券清算款	7,026,974.50
3	应收股利	-
4	应收利息	9,609.30
5	应收申购款	82,082.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,326,217.57

9.4 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。

9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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。

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
2012年1月1日至2012年12月31日	9.81%	1.18%	5.91%	1.02%	3.90%	0.16%
2011年1月1日至2011年12月31日	-25.09%	1.15%	-19.51%	1.04%	-5.58%	0.11%
自基金成立(2010年5月11日)至2010年12月31日	14.46%	1.18%	6.98%	1.32%	7.48%	-0.14%

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷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,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下,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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金申购费率最高不超过1.5%,且随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。申购费率如下表所示:

单笔申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<300万	1.2%
300万≤M<500万	0.8%
M≥500万	每笔1000元

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

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。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,其中不低于25%的部分归入基金财产。具体费率如下:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注:1年为365天,2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、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

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;

5、基金资产的资金汇划费用;

6、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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)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:

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	更新了基金托管人的相关信息。
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。
八、基金份额的申购、赎回与转换	1、更新了直销机构信息,更新了直销中心养老金客户申购费率差别收取方式; 2、在华安基金电子直销平台中增加智能手机APP平台。
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	对基金合同生效以来的业绩进行了更新。
二十一、对基金投资人的服务	1、修改对账单服务相关内容; 2、增加赎回转申购业务相关内容; 3、更新已开通本公司基金电子直销交易资金结算的银行; 4、增加第三方支付渠道"支付宝"; 5、增加iPhone交易平台对于智赢定投和智能再平衡业务的支持
二十二、其他应披露事项	披露了自2012年11月11日至2013年5月11日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一三年六月二十五日

证券代码:600234　证券简称:*ST天龙　编号:临2013--044

太原天龙集团股份有限公司
停牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

2013年6月18日起公司申请股票临时停牌。

2013年6月24日,公司收到第一大股东中铁华夏担保有限公司(以下简称"中铁华夏")《关于相关事项核查情况的回函》,主要内容为:为尽快解决天龙集团的困境,中铁华夏决定从即日起研讨筹划解决上市公司脱困的重大方案,且不限于重大资产重组、发行股份、债务重组、资产剥离、资产注入等重大事项。

同日,公司收到绵阳耀达投资有限公司(以下简称"绵阳耀达")《关于相关事项核查情况的回函》,主要内容为:目前绵阳耀达没有对天龙集团进行重大资产重组、发行股份、上市公司收购、债务重组、业务重组、资产剥离和资产注入等计划。

鉴于上述重大事项存在不确定性,为保证公平信息披露,维护投资者利益,避免造成公司股价异常波动,公司申请股票2013年6月25日继续停牌。

公司将根据相关事项进展情况及时履行信息披露义务,敬请广大投资者注意风险。

特此公告。

太原天龙集团股份有限公司
二零一三年六月二十五日

证券代码:200160　证券简称:南江B　公告编号:2013-050

承德南江股份有限公司
重大事项临时停牌进展公告

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、误导性陈述或者重大遗漏。

因公司存在将对公司产生重大影响的事项且具有不确定性,经向深圳证券交易所申请,本公司股票自2013年6月25日开市起继续停牌,直至相关事项初步确定并披露有关结果后复牌。本公司将及时披露相关事项进展情况,敬请广大投资者注意风险。

特此公告

承德南江股份有限公司
董事会
2013年6月24日

证券代码:002477　证券简称:雏鹰农牧　公告编号:2013-028

雏鹰农牧集团股份有限公司
停牌公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

雏鹰农牧集团股份有限公司(以下简称"公司")正在筹划非公开发行股票事项,因相关事项尚存在不确定性,为了避免公司二级市场股价波动,保护投资者利益,经公司向深圳证券交易所申请,公司股票已于2013年6月24日(星期一)开市起停牌,最迟于2013年6月27日(星期四)刊登相关公告后复牌。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

雏鹰农牧集团股份有限公司
董事会
二〇一三年六月二十四日

证券代码:600052　证券简称:浙江广厦　公告编号:临2013-025

浙江广厦股份有限公司
七届十九次董事会会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

浙江广厦股份有限公司第七届董事会第十九次会议通知于2013年6月18日以传真、电子邮件方式送达全体董事。会议于2013年6月24日以通讯方式召开,会议应到董事9名,实到董事9名(楼明、楼江跃、张汉文、杜鹤鸣、汪涛、成钢、陈凌、辛金国、孙笑侠亲自出席会议)。会议召开方式、程序均符合相关法律、法规、规章和《公司章程》的要求。会议审议并通过以下决议:

审议通过了《关于全资子公司浙江天都实业有限公司融资的提案》。

公司全资子公司浙江天都实业有限公司(以下简称"天都实业")拟通过金融机构委托贷款方式融资不超过4.5亿元人民币,融资期限2年,融资利率为13%左右。天都实业拟以持有的部分项目土地提供抵押,公司控股股东广厦控股集团有限公司为本次融资提供连带责任担保。

表决结果:9票同意,0票反对,0票弃权。

浙江广厦股份有限公司
董事会
二〇一三年六月二十五日

关于公司旗下基金调整停牌
股票估值方法的提示性公告

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》([2008]38号公告)、中国证券业协会基金估值工作小组下发的《关于停牌股票估值的参考方法》及我公司长期停牌股票的估值政策和程序,经与托管行协商一致,建信基金管理有限责任公司决定自2013年6月24日起对公司旗下基金持有的"华润三九"(股票代码:000999)采用"指数收益法"予以估值。

待上述股票复牌且交易体现活跃市场交易特征后,将恢复为采用当日收盘价格进行估值,届时不再另行公告。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司
二〇一三年六月二十五日

证券代码:002265　证券简称:*ST西仪　公告编号:2013-018

云南西仪工业股份有限公司
关于公司股票停牌的公告

本公司全体董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

云南西仪工业股份有限公司(以下称"公司")正在筹划重大事宜,为避免引起股票价格波动,保护投资者利益,经申请,公司股票于2013年6月25日开市起停牌,预计复牌时间不晚于2013年7月2日。公司将及时披露重大事宜进展情况,敬请广大投资者注意风险。

特此公告。

云南西仪工业股份有限公司
董 事 会
2013年6月24 日

关于汇丰晋信基金管理有限公司旗下基金
持有的长期停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)以及中国证券业协会《关于发布中证协(SAC)基金行业股票估值指数的通知》(中证协发[2009]97号)的有关规定,汇丰晋信基金管理有限公司(以下简称"本公司")于2013年6月24日采用"指数收益法"对汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金持有的停牌证券美的电器(股票代码000527)和同方股份(股票代码600100)进行估值。经托管行复核,其潜在估值调整对前一估值日基金资产净值的影响比例超过0.25%;按照有关规定和本公司的估值政策,经与托管银行商定,对汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金持有的上述证券的估值方法进行调整。即:自2013年6月24日起,本公司对汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金持有的停牌证券美的电器(股票代码000527)和同方股份(股票代码600100)采用"指数收益法"进行估值。在美的电器和同方股份复牌且其交易体现活跃市场交易特征后,本公司将恢复按市价估值方法进行估值,届时不再另行公告。

本公司旗下开放式基金将严格按照《企业会计准则》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值。投资者可登录本公司网站(www.hsbcjt.cn)或拨打本公司客户服务电话(021-20376888)了解基金份额净值变动情况。

特此公告。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对新基金业绩表现的保证。投资有风险,敬请投资者在投资基金前认真阅读《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,并根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。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。敬请投资人在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

汇丰晋信基金管理有限公司
2013年6月25日

证券代码:002528　证券简称:英飞拓　公告编号:2013-058

深圳英飞拓科技股份有限公司
股票交易异常波动公告

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。

一、股票交易异常波动情况

截止2013年6月24日,本公司股票连续三个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计达到20%以上,属于《深圳证券交易所交易规则》有关规定的股票交易异常波动情形。

二、公司关注、核实的相关情况

1、前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

2、公司未发现近期公共传媒报道了可能或已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息。

3、近期,公司生产经营情况正常,内外部经营环境未发生重大变化。

4、经查询,公司及控股股东、实际控制人不存在应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段的重大事项。

5、经查询,公司控股股东和实际控制人在股票交易异常波动期间未买卖公司股票。

三、不存在应披露而未披露的重大信息的声明

本公司董事会履行核查程序后确认,本公司目前没有任何根据深交所《股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等;董事会也未获悉本公司有根据深交所《股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的、对本公司股票交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

四、风险提示

1、经查询,公司不存在违反公平信息披露规定的情形。

2、公司在2013年第一季度报告中预计2013年1-6月归属于上市公司股东的净利润亏损500万至1000万元。目前,公司对2013年1-6月的利润情况预计维持在此范围,没有发生变化。

3、《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》和巨潮资讯网为本公司选定的信息披露媒体,公司所有信息均以公司在上述指定媒体刊登的正式公告为准。请广大投资者理性投资,注意投资风险。

特此公告!

深圳英飞拓科技股份有限公司
董事会
2013年6月25日