(上接B34版)

(87)财通证券股份有限公司
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
(88)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
(89)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
(90)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
(91)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
客户服务电话:400-089-1289
网址: www.e-rich.com.cn
(92)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋 2楼
法定代表人:汪静波
电话: 400-821-5399
网址: www.noah-fund.com
(93)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88920897 4008-773-772
网址: www.5ifund.com
(94)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
电话:400-888-6661
网址: www.myfund.com
(95)中期时代基金销售(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢2层
法定代表人:路瑶
电话:95162,4008888160
网址: www.cifcofund.com
(96)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人:李招弟
电话:4008080069
网址: www.wy-fund.com
(97)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
电话:4006-788-887
网址: www.zlfund.cn www.jjmmw.com
(98)联讯证券有限责任公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:徐刚
电话:95564、4008888929
网址: www.lxzq.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、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)31358716
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(特殊普通合伙)
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:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼
首席合伙人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:傅琛慧
经办会计师:汪棣、傅琛慧

四、基金的名称

本基金名称:华安稳固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

本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造高于比较基准收益的当期收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、央行票据、短期融资券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种;本基金还可投资于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。

本基金投资组合的资产配置范围为:债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的80%,权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%,现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。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。

本基金通过新股认购策略所认购新发行股票,在其上市后持有时间不超10个交易日,所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过5个交易日,通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。

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

(一)投资策略

本基金建立逐期追求投资本金安全的风险控制目标和收益稳定递增的产品运作风格,以"3年运作周期滚动"的方式,实施开放式运作。自本基金合同生效之日起满3年的期间,为本基金3年运作周期的"第1期",期满安排第1期后的不少于5个工作日的过渡期(此项安排将于实施的具体日期前2日在指定媒体进行公告),便于本基金在前后两个运作周期间调整组合配置,并且投资者在过渡期内办理本基金的申购和赎回业务时不收取申购、赎回费用。自本基金第1期的过渡期结束后的第1个工作日起满3年的期间,为本基金3年运作周期的"第2期",期满安排第2期后的过渡期;依此类推,本基金在持续经营中,形成"3年运作周期滚动"。本基金设定运作周期末的避险目标为力求期末基金份额净值加上当期累计分红金额不低于当期第1个工作日的基金份额净值;本基金合同生效后,首个运作期的避险目标为期末基金份额净值加上当期累计分红金额不低于1.00元/基金份额。在3年运作期内,本基金通过适当的投资策略和产品机制,增强对组合流动性的保护,以便于本基金达到避险目标,并力争超越业绩比较基准,优化基金组合的风险收益和流动性,从而力求满足投资人持续稳定地获得高于存款利率收益的需求。

1、资产配置策略

为了达到本基金的投资目标,在本金安全的基础上实现超越比较基准的收益,本基金将可投资对象分为基础资产和风险资产。其中基础资产是指久期小于等于运作周期的固定收益类资产,风险资产是指久期大于运作周期的固定收益类资产以及其他的投资对象。在两类资产配置比例上采用华安组合投资比例动态调整机制,以实现避险目标。华安组合投资比例动态调整机制是指:动态分配基金资产在基础资产和风险资产上的投资比例的投资规则和监控流程,具体如下:

① 根据数量模型,确定基金的安全垫;
② 根据安全垫和风险乘数确定风险资产投资比例上限;
③ 动态调整风险资产投资比例,风险资产实际投资比例不超过风险资产投资比例上限。

同时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多因子模型等数量工具, 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,以确定风险资产在非信用类固定收益品种(国债、央行票据等)、信用类固定收益品种、新股申购之间的配置比例。

2、债券投资策略(不含可转债)

(1)久期免疫策略

通过对资产久期的配置,规避利率风险。利率风险表现在两个方面:价格风险和再投资风险。价格风险是由于市场利率上升引起债券价格下跌给债券投资者带来的资产损失;再投资风险是由于市场利率下降引起利息的再投资收入减少给债券投资者带来的收入损失。当市场利率上升时,债券投资者面临着资产损失和再投资收入增加;而当市场利率下降时,债券投资者面临着资产增加和再投资收入损失。因此,债券的价格风险和再投资风险有相互抵消的特性, 久期免疫策略的目的就是通过持有债券至一定期限,利用两种风险互相抵消的作用来锁定投资收益率。本基金基本持有久期与运作周期相匹配的债券,主要按买入并持有方式操作以保证组合收益的稳定性,以有效回避利率风险。

(2)利差套利策略

利差套利策略主要是指利用负债和资产之间收益率水平之间利差,实行滚动套利的策略。只要收益率曲线处于正常形态下,长期利率总要高于短期利率。由于基金所持有的债券资产期限通常要长于回购负债的期限,因此可以采用长期债券和短期回购相结合,获取债券票息收益和回购利率成本之间的利差。在制度允许的情况下,还可以对回购进行滚动操作,较长期的维持回购放大的负债杠杆,持续获得利差收益。回购放大的杠杆比例根据市场利率水平,收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期进行调整,保持利差水平维持在合理的范围,并控制杠杆放大的风险。正常情况下,本基金回购融资余额不低于基金资产净值的20%。

(3)收益率曲线策略

在目标久期确定的基础上,通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期,调整组合期限结构策略(主要包括子弹式策略、两极策略和梯式策略),在短期、中期、长期债券间进行配置,从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。其中,子弹式策略是使投资组合中债券的到期期限集中于收益率曲线的一点;两极策略是将组合中债券的到期期限集中于两极;而梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。

(4)相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间市场利差等。如果预计利差将缩小,可以卖出收益率较低的债券或通过买断式回购卖空收益率较低的债券,买入收益率较高的债券;反之亦然。

(5)骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,持有一定时间后,随着债券剩余期限的缩短,到期收益率将迅速下降,基金可获得较高的资本利得收入。

(6)信用类债券投资策略

根据对宏观经济运行周期的研究,综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展前景和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后,结合具体发行契约,通过华安信用评级体制对信用类债券形成风险管理,以期实现对信用风险的免疫。在控制风险的基础上,管理人可以通过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。

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,并有利于从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

本基金将通过分析影响股票一级市场资金面的相关市场风险收益特征的变化、股票发行政策取向,预测新股一级市场供求关系的变化,并据此进一步预测认购新股中签率和新股的收益率变动趋势;同时,本基金借助行业研究员的研究建议,预测拟认购新股的中签率和认购收益率,确定合理规模的资金、精选个股认购,实现新股认购收益率的最大化。

6、权证投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证,可持有因持仓股票所派发或因参与可分离债券一级市场申购而产生的权证。本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可能持有的权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,避免投资风险,追求较高风险调整后收益。

(二)投资决策的依据和程序

严谨、科学的投资程序是投资取得成功的关键,也是稳定管理、规范运作和风险控制赖以实现的保证。本基金实行以资产配置、证券选择、组合构建、交易执行、评估与调整、数量分析及投资风险管理为核心的投资程序,强调"投资始于研究,研究创造价值"。

1、决策依据

(1)宏观研究

本基金为债券型基金,宏观经济的前瞻性研究,将有利于判断经济发展的大方向,把握经济周期,分析经济政策的导向,以及对证券市场的影响,从而为投资决策提供直接、准确的战略思路和对策。宏观经济研究对债券投资的影响表现在资产配置策略、债券组合构建、债券类属配置策略和个券选择等诸多方面,债券市场的宏观研究重点在于对利率政策、货币政策和财政政策的研究,同时市场供求关系的研究也是债券市场宏观研究的重要内容。

(2)资产配置策略研究

积极有效的资产配置是降低风险提高回报的关键要素。资产配置策略研究是在对宏观经济进行深入分析基础上展开的,通过宏观经济研究把握未来重要宏观经济变量的变化趋势,特别要对未来利率走势进行深入细致分析和预测,并在此基础之上进行基金资产配置,确定资产在债券、股票、现金(包括存款)上的投资比例。

(3)平均剩余期限确定和凸性管理

根据剩余运作周期来确定债券资产组合平均剩余期限。运用适当的凸性管理增强收益,如果预期收益率曲线变平,可以适当提高组合凸性,以便从收益率曲线变平的交易中获得超额收益;预期未来收益率曲线变陡峭,则需要降低组合的凸性,以便从收益率曲线变陡的交易中获利。

(4)个券研究

个券研究是确保投资组合取得超额投资回报和降低风险的基础。通过对个券相对于收益率曲线的低估(或高估)程度的分析,结合个券的信用等级、交易市场、流动性、息票率、税赋特征等,挖掘价值相对低估的个券。

2、决策机制和决策过程

(1)决策机制

本基金实行三级决策体系下的基金经理负责制。三级决策体系的责任主体是投资决策委员会、投资协调小组和基金经理。决策管理的原则是集体决策、分层授权、职责明确和运作规范。

(2)决策过程

本基金投资决策过程可分为以下几个步骤:

① 研究发展部和数量分析小组向投资决策委员会会议提交宏观经济分析报告、行业分析报告、利率分析报告、市场分析报告和数量分析报告,研究发展部、基金投资部和固定收益部提交投资策略分析报告,投资协调小组提交资产配置建议报告,基金经理提交债券组合分析报告和未来操作建议,供投资决策委员会会议讨论。

② 投资决策委员会月度会议讨论上述报告,并形成月度投资决策建议,确定以组合平均剩余期限控制为核心的基金债券组合的投资策略和投资计划。

③ 投资协调小组在投资决策委员会决议的框架下提出债券重点类属、重点券种、新股申购配置计划。
④ 根据基金合同、决策会议决议、投资协调小组建议和本基金投资限制,构建和调整投资组合。
⑤ 合规监察稽核部对投资决策实施实行全面监控。
⑥ 风险管理部定期对投资组合进行归因分析和绩效评估。

(3)债券投资组合构建

本基金债券投资组合构建过程主要有以下几个环节:资产配置、制定组合平均剩余期限方案、选择交易场所确定类属资产投资比例、选择债券品种。

① 资产配置

首先要通过对宏观经济、市场环境、利率趋势和所管理资产的特性进行分析确定战略资产配置,即确定投资债券与现金的配置比例,旨在提高流动性管理的效率和调控整体资产的风险暴露程度。在债券投资的资产配置方面重点关注利率风险的暴露程度、市场的流动性和所管理资产的特性以及货币市场的资金供求状况。

② 制定组合方案

通过收益率曲线策略,借助于数量模型对债券收益率曲线形态及其变动的方向和大小进行分析和判断,根据收益率曲线可能出现的平行、旋转和蝶式移动等变动形式及其组合,在平均剩余期限目标确定的基础上,将基金资产合理分配在长、中、短期债券上,形成组合方案。

③确定类属配置

通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价,以及回售等因素的综合评估,针对不同期限的品种(指长、中、短期)和不同类型品种(指零息债、固息债和浮息债以及各类含权债券)合理分配债券组合中投资于国债、金融债、企业债等债券产品的比例。

④选择债券品种

在上述约束机制下,最后通过对个券的相对价值、品种期限集中度、信用等级、市场流动性等指标的分析,组建一个有效的债券组合。

(4)组合调整

投资组合构建后由于客观条件的变化,可能需要定期或不定期进行组合调整。调整的原因主要包括:资产配置方案发生变化、组合平均剩余期限目标变化、品种选择变化等。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准=3年期银行定期存款收益率+1.68%

上述"3年期银行定期存款收益率"是指当期运作期的第1个工作日中国人民银行网站上发布的3年期"金融机构人民币存款基准利率"。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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

十一、基金投资组合报告

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2014年4月15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2014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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	150,101,943.40	86.65
	其中:债券	150,101,943.40	86.65
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	19,000,148.50	10.97
	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	919,848.85	0.53
7	其他资产	3,199,056.74	1.85
8	合计	173,220,997.49	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
3	金融债券	9,944,000.00	5.80
	其中:政策性金融债	9,944,000.00	5.80
4	企业债券	91,899,019.00	53.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	29,941,000.00	17.47
7	可转债	18,317,924.40	10.69
8	其他	-	-
9	合计	150,101,943.40	87.56

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	122801	11焦作债	300,080	30,068,016.00	17.54
2	122918	10阜阳债	281,970	28,168,803.00	16.43
3	1282033	12协鑫 MTN1	200,000	19,998,000.00	11.67
4	122075	11柳钢债	200,000	19,000,000.00	11.08
5	090211	09国开11	100,000	9,944,000.00	5.80

6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

11 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	79,512.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,011,822.11
5	应收申购款	107,722.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,199,056.74

11.4 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	110023	民生转债	8,851,000.00	5.16
2	113003	重工转债	2,547,424.40	1.49

11.5 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的情况。

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(截止时间2013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
自2010年12月21日(合同生效日)起至2010年12月31日止	0.10%	0.03%	0.17%	0.01%	-0.07%	0.02%
自2011年1月1日起至2011年12月31日止	4.40%	0.17%	5.53%	0.02%	-1.13%	0.15%
自2012年1月1日起至2012年12月31日止	7.26%	0.09%	5.53%	0.02%	1.73%	0.07%
自2013年1月1日起至2013年12月31日止	-0.68%	0.19%	5.53%	0.02%	-6.21%	0.17%

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.65%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.65%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.18%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1、基金销售服务费

本基金的销售服务费年费率为0.35%。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基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H为基金份额每日应计提的销售服务费

E为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前3个工作日内从基金财产中划出,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。

2、申购费

本基金申购费率最高不超过申购金额的1.5%。本基金的申购费用由申购人承担,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。

本基金申购费率为零。

3、赎回费

本基金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赎回费用。本基金的赎回费用全部计入基金资产。

本基金运作期和过渡期设定的赎回费率不同。

(1)过渡期的赎回费率

在过渡期内,本基金的赎回费率为零。

(2)运作期内的赎回费率

在运作期内,本基金的赎回费率按照基金份额持有人在当期运作期的持有时间递减。在适用本基金运作期的赎回费率时,本基金只计算基金份额持有人在当期运作期的持有期限,对于基金份额持有人在当期运作期以外的过渡期或运作期的持有期限不累计计算。具体如下:

当期运作期持有期限	赎回费率
不满90天	1%
满90天,但不满365天	0.5%
满365天,但不满730天	0.3%
满730天,至本基金3年当期运作期期满日之间(含该期满日)	0.2%

4、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T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T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T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。

(三)其他费用

1、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
2、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
3、基金份额持有人大会费用;
4、基金的证券交易或结算而产生的费用;
5、基金的银行汇划费用;
6、按照国家有关规定和《基金合同》约定,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

1、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;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(五)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。
五、相关服务机构	1、更新了部分代销机构的信息; 2、更新了会计师事务所和经办注册会计师的信息。
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业绩表现。
二十一、对基金投资人的服务	1、六-6,删除WAP服务,更新表格; 2、七-7,删除WAP服务,更新表格; 3、八-删除"人工服务时间:交易日9:00-21:00"。
二十二、其他应披露事项	披露了自2013年12月21日至2014年6月21日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一四年八月五日

(上接B33版)

四、董事会意见

本公司第五届董事会第五次会议审议通过了 《关于新增2014年度对子公司提供对外担保事项的议案》,公司董事会认为:

1.浙江万丰摩轮有限公司经营状况良好,本次新增融资需求是为了促进年度计划的实现,有利于更好的调整公司负债结构,我们同意为其向中国银行新昌支行融资提供担保;

2.吉林万丰奥威汽轮有限公司是公司的战略布局,本次新增为其向建设银行吉林分行提供综合授信额度10,000万元担保,有利于降低公司融资成本,有利于实现股东利益最大化,我们同意为其向建设银行吉林分行融资提供担保。本次新增担保事项获批后,原公司为吉林万丰奥威汽轮有限公司向中信银行吉林分行申请的综合授信额度10,000万元所提供的担保予以终止。

3.同意将该提供担保事宜提交公司2014年第一次临时股东大会审议。

五、独立董事意见

公司独立董事孙大建、孙伯淮、荆林波出具了如下独立意见:

经核查董事会会议资料和浙江万丰摩轮有限公司、吉林万丰奥威汽轮有限公司财务报表等相关资料,我们认为:

该事项符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及公司《章程》等相关规定,担保项下的融资用途适当,被担保对象的经营及财务状况健康,提供上述担保符合全体股东及公司利益,全体独立董事同意为控股子公司浙江万丰摩轮有限公司新增担保金额为人民币18,500万元、全资子公司吉林万丰奥威汽轮有限公司新增担保金额为人民币10,000万元 (原经公司于2014年5月5日召开的2013年度股东大会批准的, 由公司为吉林万丰奥威汽轮有限公司向中信银行吉林分行申请的综合授信额度10,000万元所提供的担保予以终止),并同意将该事宜提交公司2014年第一次临时股东大会审议。

六、公司累计对外担保数量及逾期担保的数量

截止2014年6月30日,为子公司威海万丰汽轮有限公司、宁波奥威尔轮毂有限公司、浙江万丰摩轮有限公司、吉林万丰奥威汽轮有限公司、威海万丰镁业科技发展有限公司提供担保的期末余额47,000万元、为控股股东万丰奥特控股集团有限公司控股子公司山西天硕项目投资管理有限公司收购MLTH Holding Inc.提供担保的期末余额为82,262.94万元,合计占公司2013年12月31日经审计净资产166,719.65万元的77.53%、2014年6月30日未经审计净资产187,175.02万元的69.06%,占公司2013年12月31日经审计总资产421,262.75万元的30.68%、2014年6月30日未经审计总资产435,898.92万元的29.65%,上述担保项下实际发生借款91,401.23万元。

截止本报告披露日,以上在上述担保项下实际发生借款91,401.23万元

截止本公告披露日,公司不存在逾期对外担保情况。

七、备查文件:

1、公司第五届董事会第五次会议决议;

2、公司独立董事意见。

特此公告。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司
董 事 会
2014年8月5日

股票代码:002085 股票简称:万丰奥威 公告编号:2014-033

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司关于召开2014年第一次临时股东大会的通知

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,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司(以下简称"公司")第五届董事会第五次会议审议通过了《关于提请召开公司2014年度第一次临时股东大会的议案》,现就召开2014年度第一次临时股东大会相关事项通知如下:

一、召开会议基本情况

(一)会议召集人:公司董事会

(二)会议召开方式:现场表决和网络投票相结合的方式。

同一表决权只能选择现场、网络或其他表决方式中的一种。同一表决权出现重复表决的以第一次投票结果为准。

(三)现场会议

1、会议召开时间和日期:2014年8月21日下午2:30

2、会议地点:浙江省新昌县万丰科技园

(四)网络投票

1、网络投票时间:

(1)通过深圳证券交易所交易系统投票时间为:2014年8月21日上午9:30~11:30,下午1:00~3:00。

(2) 通过互联网投票系统投票的具体时间为:2014年8月20日下午3:00至2014年8月21日下午3:00期间的任意时间。

2、网络投票方式(可选择以下两种投票方式中的一种进行投票):

(1)深圳证券交易所交易系统。

(2)互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn)。

二、会议审议事项

1.审议《关于公司2014年半年度利润分配的议案》(需要以特别决议通过);

2.审议《关于新增2014年度贷款计划的议案》;

3.审议《关于新增2014年度对子公司提供对外担保的议案》;

4.审议《关于修订〈公司章程〉的议案》(需要以特别决议通过);

5.审议《关于修订〈股东大会议事规则〉的议案》;

本次会议审议事项符合《公司法》、《证券法》、《公司章程》等法律、法规的相关规定。上述议案已经公司2014年8月2日第五届董事会第五次会议、第五届监事会第四次会议审议,详细内容见2014年8月5日的《证券时报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)刊登的决议公告。

三、股权登记日:2014年8月21日

四、出席会议人员资格:

1.公司董事、监事和高级管理人员及公司聘请的见证律师;

2.截止2014年8月18日(如遇停牌或休市,以该日前最后一个交易日)下午交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东;

3.股东因故不能出席会议的可书面授权委托他人(不必是公司股东)出席(授权委托书附后)。

五、登记办法:

(1)登记时间:2014年8月20日上午9:00-11:30,下午13:30—17:00。

(2)登记手续:法人股股东代表持最新营业执照复印件、法人授权委托书、出席人身份证明书(均加盖公章);个人股股东持本人身份证、深圳股票账户卡和持股凭证;股东授权代理人持本人身份证、委托人授权委托书、委托人身份证复印件及委托人深圳股票账户卡和持股凭证到公司办理出席会议登记手续;外地股东可用信函或传真方式登记。

(3)登记地点:浙江新昌浙江万丰奥威汽轮股份有限公司董事会办公室(邮编:312500)。

六、参与网络投票的股东的身份认证与投票程序

(一)采用交易系统投票的操作流程

1、通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为2014年8月21日上午9:30~11:30,下午1:00~3:00,投票程序比照深圳证券交易所新股申购业务操作。

2、投票代码:362085;投票简称:万丰投票

3、股东投票的具体程序为:

(1)进行投票时买卖方向应选择"买入";

(2)在"委托价格"项下填本次临时股东大会议案序号,100.00代表总议案,1.00代表议案1,2.00代表议案2,依此类推。每一议案以相应的委托价格分别申报。股东对"总议案"进行投票,视为对所有议案表达相同意见

本次临时股东大会议案对应"委托价格"具体情况如下:

议案序号	议案名称	对应申报价
100	总议案	100.00
1	《关于公司2014年半年度利润分配的议案》	1.00
2	《关于新增2014年度贷款计划的议案》;	2.00
3	《关于新增2014年度对子公司提供对外担保的议案》;	3.00
4	《关于修订〈公司章程〉的议案》(需要以特别决议通过);	4.00
5	《关于修订〈股东大会议事规则〉的议案》;	5.00

(3)输入委托股数:输入"委托股数"表达表决意见,委托股数与表决意见的对照关系如下表:

表决意见类型	委托数量
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

(5)在股东大会审议多个议案的情况下,如股东对所有议案均表示相同意见,则可以只对"总议案"进行投票。

如股东通过网络投票系统对总议案和单议案进行了重复投票的,以第一次有效投票为准,即如果股东先对议案1、议案2、议案3、议案4、议案5中的一项或多项进行投票表决,再对总议案投票表决,则以股东对议案1、议案2、议案3、议案4、议案5已投票表决议案的表决意见为准,未投票表决的议案,以对总议案的投票表决意见为准;如果股东先对总议案投票表决。然后对议案1、议案2、议案3、议案4、议案5的一项或多项议案投票表决,则以对总议案的投票表决意见为准。

(6)对同一议案只能申报一次,不能撤单,多次申报的,以第一次申报为准。

(7)不符合上述规定的投票申报无效,视为未参与投票。

(二)采用互联网投票的操作流程

1、股东获取身份认证的具体流程

按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定,股东可以采用服务密码或数字证书的方式进行身份认证。

(1)申请服务密码的流程

登陆网址:http://wltp.cninfo.com.cn 的"密码服务专区";填写"姓名"、"证券账户号"、"身份证号"等资料,设置6-8位的服务密码,如申请成功,系统会返回一个4位数字的激活校验码。

(2)激活服务密码

股东通过深交所交易系统比照买入股票的方式,凭借"激活校验码"激活服务密码。

该服务密码需要通过交易系统激活后使用。如服务密码激活指令上午11:30前发出的,当日下午1:00即可使用;如服务密码激活指令上午11:30后发出的,次日方可使用。

服务密码激活后长期有效,在参加其他网络投票时不必重新激活。密码激活后如遗失可通过交易系统挂失,挂失后可重新申请,挂失方法与激活方法类似。申请数字证书的,可向深圳证券信息公司或其委托的代理发证机构申请。

2、股东根据获取的服务密码或数字证书登录网址 http ://wltp.cninfo.com.cn 的互联网投票系统进行投票。

(1)登录http://wltp.cninfo.com.cn,在"上市公司股东大会列表"选择"浙江万丰奥威汽轮股份有限公司2014年第一次临时股东大会投票";

(2)进入后点击"投票登录",选择"用户名密码登陆",输入您的"证券账户号"和"服务密码";已申领数字证书的投资者可选择CA证书登录;

(3)进入后点击"投票表决",根据网页提示进行相应操作;

(4)确认并发送投票结果。

3、投资者通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的起止时间为2014年8月20日下午3:00至2014年8月21日下午3:00的任意时间。

(三)网络投票其他注意事项

1、网络投票系统按股东帐户统计投票结果,如同一股东帐户通过深圳证券交易所系统和互联网交易系统两种方式重复投票,股东大会表决结果以第一次有效投票结果为准。

2、如某一股东仅对议案1或议案2进行投票,在计票时,视为该股东出席股东大会,纳入出席股东大会股东总数的计算;对于该股东未发表意见的其他议案,视为弃权。

3、如需查询投票结果,请于投票当日下午18:00以后登陆深圳证券交易所互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn),点击"投票查询"功能,可以查看个人网络投票结果。

七、其他

(一)现场会议联系方式:

联系人:徐晓芳 章银凤

电 话:0575-86298339

传 真:0575-86298339

地 址:浙江省新昌县万丰科技园浙江万丰奥威汽轮股份有限公司董事会办公室(邮编:312500)。

(二)会议费用:与会人员食宿及交通费自理。

(三)网络投票期间,如投票系统受到突发重大事件的影响,则本次相关股东会议的进程按当日通知进行。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司
董 事 会
2014年8月5日

附件:

授权委托书

兹全权委托　　　　先生(女士)代表　　　　单位(个人)出席浙江万丰奥威汽轮股份有限公司2014年第一次临时股东大会并代为行使表决权。本人(或本公司)对本次会议审议事项的意见如下:

序号	审议事项	赞成	反对	弃权
1	《关于公司2014年半年度利润分配的议案》(需要以特别决议通过)			
2	《关于新增2014年度贷款计划的议案》;			
3	《关于新增2014年度对子公司提供对外担保的议案》;			
4	《关于修订〈公司章程〉的议案》(需要以特别决议通过);			
5	《关于修订〈股东大会议事规则〉的议案》;			

注:对上述审议事项选择赞成、反对或弃权并在相应表格内打勾,三者中只能选其一,选择一项以上或未选择的,则视为授权委托人对审议事项投弃权票。

委托人姓名或名称(签章):
委托人(法人代表):
委托人股东账户:
委托人持股数:
身份证号码(营业执照号码):
被委托人签名:
被委托人身份证号码:
委托书有效期限:
委托日期:

注:授权委托书剪报、复印或按以上格式自制均有效;单位委托须加盖单位公章。

证券代码:200706 证券简称:瓦轴B 公告编号:2014-21

瓦房店轴承股份有限公司2013年年度权益分派实施公告

瓦房店轴承股份有限公司,2013年年度权益分派方案已获2014年6月18日召开的2013年年度股东大会审议通过,现将权益分派事宜公告如下:

一、权益分派方案

本公司2013年年度权益分派方案为:以公司现有总股本402,600,000股为基数,向全体股东每10股派0.40元人民币现金(含税;扣税后,B股非居民企业扣税后每10股派现金0.36元,境内(外)个人股东的股息红利税实行差别化税率征收,先按每10股派0.38元,权益登记日后根据投资者减持股票情况,再按实际持股期限补缴税款1。)

【注1:根据先进先出原则,以投资者证券账户为单位计算持股期限,持股1个月(含1个月)以内,每10股补缴税款0.06元;持股1个月以上至1年(含1年)的,每10股补缴税款0.02元;持股超过1年的,不需要补缴税款。】

向B股股东派发的现金红利,B股股息折算汇率按照股东大会决议日后第一个工作日, 即 2014年6月19日的中国人民银行公布的人民币兑港币的中间价(港币:人民币=1:0.7938)折合港币兑付。

二、股权登记日与除权除息日

本次权益分派B股最后交易日为:2014年8月11日; 除权除息日为:2013年8月12日;股权登记日为:2013年8月14日。

三、权益分派对象

本次分派对象为:截止2014年8月14日(最后交易日为2014年8月11日)下午深圳证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司(以下简称"中国结算深圳分公司")登记在册的本公司全体B股股东。

四、权益分派方法

1、本公司此次委托中国结算深圳分公司代派的B股股东的现金红利将于2014年8月14日通过股东托管证券公司(或其他托管机构)直接划入其资金账户。如果B股股东于2014年8月14日办理股份转托管的,其现金红利仍在原托管证券公司或托管银行处领取。

发起人国有法人股,高管锁定股现金红利本公司将自行派发。

五、其他事项说明

B股股东中如果存在不属于境内个人股东或非居民企业但所持红利被扣所得税的情况,请于2014年8月31日前(含当日)与公司联系,并提供相关材料以便进行甄别,确认情况属实后公司将协助返还所扣税款。

六、咨询机构:

咨询地址:辽宁省瓦房店市北共济街一段一号投资证券部

咨询联系人:柯馨

咨询电话:0411-39116732 传真电话: 0411-39116738

瓦房店轴承股份有限公司
2014年8月4日

证券代码:000598 证券简称:兴蓉投资 公告编号:2014-46

成都市兴蓉投资股份有限公司关于公开发行2014年公司债券申请获得中国证监会发审会审核通过的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2014年8月1日,中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发行审核委员会对成都市兴蓉投资股份有限公司(以下简称"公司")公开发行2014年公司债券的申请进行了审核。根据审核结果,本次发行公司债券的申请获得通过。公司将在收到中国证监会的核准批复文件后另行公告。

特此公告。

成都市兴蓉投资股份有限公司
董 事 会
2014年8月4日

证券代码:000598 证券简称:兴蓉投资 公告编号:2014-47

成都市兴蓉投资股份有限公司关于银川新兴蓉投资发展有限责任公司第六污水处理厂获得商业试运行批复的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

银川市建设局于2014年8月1日出具《关于银川新兴蓉投资发展有限责任公司第六污水处理厂商业试运行的批复》(银建发[2014]392号,以下简称"批复")。根据批复,银川新兴蓉投资发展有限责任公司第六污水处理厂BOT项目(以下简称"第六污水处理厂BOT项目",现有规模2.5万吨/日)各项工作均符合商业试运行管理要求,具备商业试运行条件,自2014年7月1日起,银川市建设局正式对第六污水处理厂BOT项目商业试运行进行特许经营监管。

特此公告。

成都市兴蓉投资股份有限公司
董 事 会
2014年8月4日