证券代码:600256　证券简称:广汇能源　公告编号:2015-011

广汇能源股份有限公司 2015年度对外担保的补充公告

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。

广汇能源股份有限公司（以下简称"公司"）于2015年1月30日在上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn/）上披露了《广汇能源股份有限公司2015年度对外担保公告》（2015-005),根据上海证券交易所要求,现将被担保人基本情况的主要财务指标补充至一年又一期内容:

1、新疆广汇煤炭清洁炼化有限责任公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产146,139.84万元,负债总额114,721.26万元,贷款总额0.00万元,流动负债总额114,721.26万元,净资产31,418.58万元,营业收入为105.70万元,净利润-581.42万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产309,589.04万元,负债总额278,545.26万元,贷款总额0.00万元,流动负债总额253,371.36万元,净资产31,043.78万元,营业收入为20.31万元,净利润-374.80万元(未经审计)。

2、广汇能源综合物流发展有限责任公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产37,094.52万元,负债总额16,816.00万元,贷款总额4,800.00万元,流动负债总额16,780.37万元,净资产20,278.53万元,营业收入为27,360.87万元,净利润9.43万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产44,003.56万元,负债总额23,685.52万元,贷款总额5,680.00万元,流动负债总额23,266.14万元,净资产20,318.04万元,营业收入为22,602.52万元,净利润39.51万元(未经审计)。

3、新疆广汇新能源有限公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产1,215,818.01万元,负债总额894,254.34万元,贷款总额372,310.00万元,流动负债总额650,082.41万元,净资产321,563.67万元,营业收入为151,504.64万元,净利润-26,668.14万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产1,202,925.41万元,负债总额834,224.55万元,贷款总额262,600.00万元,699,896.63万元,净资产368,700.87万元,营业收入为224,229.74万元,净利润49,885.40万元(未经审计)。

4、新疆广汇液化天然气发展有限责任公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产425,321.37万元,负债总额182,068.86万元,贷款总额87,386.68万元,流动负债总额145,454.89万元,净资产243,252.51万元,营业收入为219,193.17万元,净利润42,421.89万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产444,162.21万元,负债总额167,913.10万元,贷款总额78,485.61万元,流动负债总额142,060.31万元,净资产276,249.11万元,营业收入为238,816.50万元,净利润32,432.83万元(未经审计)。

5、新疆富蕴广汇新能源有限公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产151,723.12万元,负债总额110,793.75万元,贷款总额0.00万元,流动负债总额88,045.03万元,净资产40,929.37万元,营业收入为0.78万元,净利润-313.50万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产177,910.25万元,负债总额137,249.18万元,贷款总额0.00万元,流动负债总额122,208.25万元,净资产40,661.08万元,营业收入为4.08万元,净利润-268.30万元(未经审计)。

6、甘肃宏汇能源化工有限公司

主要财务指标:截止2014年9月30日,该公司总资产20,310.42万元,负债总额321.27万元,贷款总额0.00万元,流动负债总额321.27万元,净资产19,989.15万元,营业收入为0.00万元,净利润-10.85万元(未经审计)。

7、新疆广汇石油有限公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产279,439.78万元,负债总额226,565.96万元,贷款总额190,630.67万元,流动负债总额88,349.24万元,净资产52,873.82万元,营业收入为736.74万元,净利润-738.90万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产540,029.35万元,负债总额364,840.44万元,贷款总额225,796.75万元,流动负债总额91,000.35万元,净资产175,188.91万元,营业收入为15,877.86万元,净利润62,201.17万元(未经审计)。

8、新疆红淖三铁路有限公司

主要财务指标:

截止2013年12月31日,该公司总资产380,751.03万元,负债总额270,475.86万元,贷款总额100,000.00万元,流动负债总额270,344.59万元,净资产110,275.17万元,营业收入为94.40万元,净利润-506.94万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产494,021.82万元,负债总额384,017.93万元,贷款总额220,000.00万元,流动负债总额283,908.17万元,净资产110,003.90万元,营业收入为0.5万元,净利润-271.27万元(未经审计)。

9、瓜州广汇能源物流有限公司

主要财务指标:

截止2014年12月31日,该公司总资产188,504.19万元,负债总额71,076.03万元,贷款总额7,000.00万元,流动负债总额67,076.03万元,净资产117,428.15万元,营业收入为62,519.05万元,净利润4,907.38万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产166,069.80万元,负债总额48,804.87万元,贷款总额1,500.00万元,流动负债总额48,804.87万元,净资产117,264.93万元,营业收入为24,269.43万元,净利润-163.22万元(未经审计)。

10、新疆哈密广汇物流有限公司

主要财务指标:截止2013年12月31日,该公司总资产102,590.84万元,负债总额77,721.24万元,贷款总额4,000.00万元,流动负债总额77,721.24万元,净资产24,869.61万元,营业收入为58,844.35万元,净利润13,349.95万元(经审计)。

截止2014年9月30日,该公司总资产108,728.51万元,负债总额76,444.07万元,贷款总额3,000.00万元,流动负债总额76,444.07万元,净资产32,284.44万元,营业收入为48,958.76万元,净利润7,414.83万元。(未经审计)

除上述补充内容外,公司于2015年1月30日在上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn/)上披露的《广汇能源股份有限公司2015年度对外担保公告》其他内容不变。

特此公告。

广汇能源股份有限公司董事会
二○一五年二月三日

易方达基金管理有限公司关于易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金估值调整情况的公告

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》(中国证券监督管理委员会公告[2008]38号)的有关规定,经与基金托管人协商一致,自2015年2月2日起,易方达基金管理有限公司(以下简称"本公司")对易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金,在其当日份额净值的基础上,考虑其持有的"新华保险(证券代码:601336)"采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》中的"指数收益法"计算所得估值的影响,并按此调整因素进行估值。

待"新华保险"复牌且交易体现活跃市场交易特征后,本公司将对易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有的易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金,恢复采用其估值日当日的份额净值进行估值。届时不再另行公告,敬请投资者予以关注。

投资者可登陆基金管理人网站(www.efunds.com.cn)或拨打客户服务电话400-881-8088咨询有关信息。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2015年2月3日

易方达基金管理有限公司关于直销中心停止办理易方达增金宝货币市场基金申购、转换转入业务的公告

因业务调整的需要,易方达基金管理有限公司(以下简称"本公司")直销中心自2015年2月3日起停止办理易方达增金宝货币市场基金(以下简称"本基金",基金代码:001010)的申购、转换转入业务,但本基金在直销中心的赎回、转换转出等业务仍正常办理。

投资者可通过以下途径咨询有关情况:

本公司客户服务电话:400-881-8088 ,网址:www.efunds.com.cn

本公告的解释权归本公司。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2015年2月3日

南方双元债券型证券投资基金基金份额发售时间的提示性公告

南方基金管理有限公司(以下简称"本公司")于2015年1月15日发布了南方双元债券型证券投资基金(以下简称"本基金")的招募说明书和基金份额发售公告,本基金基金份额发售日期为2015年1月20日至2015年2月6日,基金简称"南方双元",基金代码"A类000997,C类000998",请投资人留意。

一、根据上述公告的约定,本基金的募集结束日期为2015年2月6日,即2015年2月6日仍然接受认购申请,投资人须于各销售机构约定的认购受理时间内提交申请,2015年2月7日起不再接受认购申请。

二、根据发售情况对参与本基金认购的销售机构进行了调整,调整后的销售机构如下:

1、直销机构:南方基金管理有限公司

2、代销机构:交通银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、深圳农村商业银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、乌鲁木齐市商业银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、河北银行股份有限公司、广东顺德农村商业银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、珠海华润银行股份有限公司、吉林银行股份有限公司、威海市商业银行股份有限公司、山东寿光农村商业银行股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司 、中信证券(山东)有限责任公司、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、江海证券有限公司、国联证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、大同证券经纪有限责任公司、东海证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、五矿证券有限公司、天相投资顾问有限公司、联讯证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中期资产管理有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司 、宜信普泽投资顾问(北京)有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、泛华普益基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司 、深圳宜投基金销售有限公司、中国国际期货有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、海银基金销售有限公司

上述排名不分先后。

三、特别提示

1、本基金发售的详细事项请查阅本基金的份额发售公告、招募说明书及最新相关公告。投资人可访问南方基金管理有限公司网站(www.nffund.com)或拨打全国免长途费的客户服务电话(400—889—8899)咨询相关情况。

2、在投资本基金前,投资人应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资有风险,投资人认购基金时应认真阅读本基金的基金合同及招募说明书。

南方基金管理有限公司
2015年2月3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

根据中国证监会2008年9月12日下发的[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会2013年5月20日下发的[2013]13号《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》及南方基金管理有限公司(以下简称"我公司")长期停牌股票的估值政策和程序,基金持有已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,相应股票应参考应用上述有关规定中的行业估值指数确定其公允价值。

我公司旗下南方积极配置证券投资基金、南方绩优成长股票型证券投资基金、南方成份精选股票型证券投资基金、南方盛元红利股票型证券投资基金、南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方策略优化股票型证券投资基金、南方天元新产业股票型证券投资基金、南方绝对收益策略定期开放混合型发起式基金持有的新华保险（股票代码601336)自2015年1月19日起停牌。经我公司与托管行协商一致,自2015年2月2日起采用"指数收益法"对上述基金持有的新华保险估值,自其复牌之日起且其交易体现了活跃市场交易特征后,按市场价格进行估值,届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

特此公告。

南方基金管理有限公司
二○一五年二月三日

股票简称:海南椰岛　股票代码:600238　编号:临2015-010

海南椰岛(集团)股份有限公司副总经理兼董事会秘书辞职公告

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。

2015 年1月30日,公司收到现任副总经理兼董事会秘书李勇先生的辞职报告。因工作原因,李勇先生请求辞去公司副总经理及董事会秘书职务。李勇先生辞职后,将不在公司担任其他职务。

李勇先生任公司副总经理及董事会秘书期间勤勉尽责，为公司规范运作和健康发展发挥了积极作用。在此,公司董事会对李勇先生在任职期间所做的贡献表示衷心感谢。

公司董事会秘书空缺期间,由公司董事长雷立先生代行董事会秘书职责,直至公司聘任新的董事会秘书。

特此公告。

海南椰岛(集团)股份有限公司
董事会
2015年2月2日

股票简称:海南椰岛　股票代码:600238　编号:临2015-011

海南椰岛(集团)股份有限公司总经理辞职公告

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。

2015 年1月30日,公司收到现任总经理李大刚先生的辞职报告。因工作原因,李大刚先生请求辞去公司总经理职务。李大刚先生辞职后,将不在公司担任其他职务。

李大刚先生任公司总经理期间勤勉尽责,为公司规范运作和健康发展发挥了积极作用。在此,公司董事会对李大刚先生在任职期间所做的贡献表示衷心感谢。

特此公告。

海南椰岛(集团)股份有限公司
董事会
2015年2月2日

证券代码:600238　股票简称:海南椰岛　编号:临2015-012

海南椰岛(集团)股份有限公司重大事项继续停牌公告

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。

海南椰岛(集团)股份有限公司(以下简称"公司")于2014年11月27日接到海口市国有资产经营有限公司(以下简称"国资公司")《关于申请海南椰岛(集团)股份有限公司临时停牌的通知》,因正在筹划重大事项,公司股票自2014年11月28日起停牌(详见公司在指定媒体披露的临2014-043号公告)。

公司分别于 2014年12月3日、2014年12月11日、2014年12月18日、2014年12月25日、2015年1月5日、2015年1月9日、2015年1月16日、2015年1月26日接到国资公司通知，申请公司股票继续停牌,并由我司披露重大事项继续停牌公告。(详见公司在指定媒体披露的临 2014-044号、2014-045号、2014-046 号、2014-049号、2015-001 号、2015-003号、2015-004号、2015-006号公告)

2015年1月30日,公司接到国资公司《关于海南椰岛(集团)股份有限公司国有股份转让事项进展情况的通知》:国资公司按照《国有股东转让所持上市公司股份管理暂行办法》的相关规定,积极推进转让所持海南椰岛全部国有股份的交易工作。国资公司已于2014年12 月5日向海口市国资委请示协议转让所持海南椰岛全部国有股份公开征集受让方事宜。海口市国资委已经批复同意国资公司通过公开征集受让方方式协议转让所持海南椰岛全部国有股份并于2014年12月19日呈报海南省国资委。目前,海南省国资委已经意向性同意,并呈报海南省政府审批。预计2015年2月27日前完成公开征集的准备工作,如不能按预计时间完成,国资公司将终止此次国有股权转让事项。

由于本次国有股份转让尚存在不确定性,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,经公司申请,公司股票自2015年2月3日起继续停牌。公司将于股票停牌之日起的5个交易日内公告相关进展情况。

公司指定的信息披露报刊为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn),有关公司信息均以在上述指定媒体刊登的信息为准。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

海南椰岛(集团)股份有限公司
董事会
2015年2月2日

(上接B53版)

法定代表人:沈继宁
客服电话:0571-96336
网址:www.ctsec.com
(89) 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
(90) 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
(91) 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
(92) 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
(93) 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
(94) 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:易峰
电话:0571-88920897　　4008-773-772
网址: www.5ifund.com
(95) 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
(96) 中期资产管理有限公司
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
(97) 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号院盘古大厦A座3201
法定代表人:李招弟
电话:4008080069
网址: www.wy-fund.com
(98) 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
法定代表人:薛峰
电话:4006-788-887
网址: www.zlfund.cn　　www.jjmmw.com
(99) 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
(100)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F
法定代表人:王莉
电话:021-20835787
传真:021-20835879
(101)中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人:王兵
客服电话:95162
公司网站:www.cifco.net
(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:朱学华
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取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期期间调整组合配置,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"。本基金设定运作期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后因分析和绩效评估。

(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10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2014年9月30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	168,475,895.00	94.32
	其中:债券	168,475,895.00	94.32
	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	-	-
	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	7,306,150.57	4.09
7	其他资产	2,841,199.03	1.59
8	合计	178,623,244.60	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