（上接B70版）

法定代表人：王兵
客服电话： 95162
公司网站：www.cifco.net
(28)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：王常青
客户服务电话:95587
网址:www.csc108.com
(29)浙时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
客户服务电话:4006989898
网址：www.xsdzq.cn
(30)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
客户服务电话:96518
网址：www.hazq.com
(31)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
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
(32)北京增财基金销售有限公司
客户服务电话：400-001-8811
网址：http:/www.zcvc.com.cn
注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
法定代表人：贺细安
联系电话:010-67000988
传真号码:010-67000988-6000
(33)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：张晶
联系电话： 021-33323998
传真号码： 021-33323993
客户服务电话：400-820-2819
网址：fund.bundtrade.com
(34)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:丁学东
电话：010)65051166
传真：010)65051166
客户服务电话：010)65051166
网址:www.cicc.com.cn
(35)太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人:李长伟
客服电话:0871-68898130
网址:http:/www.tpyzq.com
(二)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)律具法律意见书的律师事务所
名称:上海市源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话：021)51150298
传真：021)51150398
联系人:刘佳
经办律师:刘佳、张兰
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
执行事务合伙人:吴港平
电话：021)22288888
传真：021)22280000
联系人:边卓群
经办会计师:边卓群、蒋燕华

四、基金的名称

本基金名称:华安双债添利债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在合理控制风险的前提下，通过主动管理充分捕捉可转债和信用债市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类品种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相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起的90个交易日内卖出。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，其中对可转债和信用债的投资比例合计不低于非现金基金资产的80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金所指信用债包括中期票据、非政策性金融债、企业债、公司债、城投债、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债等除国债、政策性金融债和中央银行票据之外的、非由国家信用担保的固定收益类金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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

本基金主要围绕可转债和信用债市场中的投资机会，基于此目标，本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整固定收益类资产配置比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上，综合考量可转债的内在价值、信用债的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。

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，结合投资时钟理论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，以确定基金资产在可转债、信用债、利率债以及货币市场工具之间的配置比例。

2、可转债投资策略

本基金将积极参与公司基本面良好、申购收益高、发行条款好的可转债的一级市场申购，待其上市后依据对其正股的判断以及可转债合理定价水平决定继续持有或卖出；同时本基金将综合运用多种投资策略在可转债二级市场上进行投资操作，力争在风险可控的前提下获取较高的投资收益。

①传统可转债投资策略

传统可转债指可转换公司债券，投资者可在事先约定的期限内按照事先确定的价格将持有的债券转换为公司普通股。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。当对应正股股价下跌时，可转换公司债券的价格可以受到债券价值的支撑；当对应正股股价上涨时，可转换公司债券均含的期权使其可以分享股价上涨带来的收益。可转换公司债券的理论价值应该等于作为普通公司债券的基础价值加上内含的转股期权价值。

①仓位选择策略

当市场出现超卖或超买时，仓位选择有利于充分把握市场机会、规避系统风险。参考FED（美联储）模型、宏观经济模型等数量工具，本基金将可转债市场对应正股的整体估值水平与公司债市场到期收益率的倒数进行比较，并参考可转债市场整体到期收益率水平，来进行可转债的仓位配置。当正股整体估值水平较低，投资价值显著高于公司债、且可转债市场整体到期收益率水平接近或大于零时，参考可转债指数的构成，进行买入操作并逐步提高可转债仓位。反之，卖出并快速降低可转债仓位。

②行业选择和类型选择策略

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地位，对行业发展进行预测，结合估值水平与资本市场环境，确定本基金重点投资行业所对应的可转债。

同时，结合可转债的绝对价格、到期收益率以及转股溢价水平，本基金将可转债分为偏债型、平衡型和偏股型可转债，结合市场状况，确定重点投资的可转债类型。

③精选个券策略

本基金将对所有可转债对应的正股进行深入研究，采用定性分析与定量分析相结合的方法，精选成长性好且估值合理的正股所对应的可转债，并在可转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。

正股定性分析包括行业集中度及行业地位，具备独特的核心竞争优势和定价能力；具备中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力；规模效应明显；产业链分工中占据高端环节或具有产业升级潜力；从落后技术向高新技术转化，从低附加值向高附加值转化，从制造型向创造型转化；良好的公司治理结构、优秀、诚信的公司管理层等。定量分析包括盈利能力、成长能力、运营能力、负债水平、资产重置价格、市盈率、市净率、企业价值倍数、现金流贴现值等。

可转债估值指标包括转股溢价率、到期收益率、理论价值、隐含波动率、Delta值等。

④条款博弈策略

国内可转债通常具有赎回条款、修正条款、回售条款，这些条款在特定情况下对可转债的投资价值有较大影响。赎回条款、赋予发行人提前赎回可转债的权利，如发行人行使赎回权将抑制可转债的上涨空间，而放弃赎回权则会提高可转债的期权价值；修正条款，赋予发行人向下修正转股价的权利，如发行人行使修正权将有利于提升可转债的期权价值，间接推动可转债价格的上涨；回售条款，赋予投资者将可转债回售给发行人的权利，是对投资者的保护。此外因增发或分红等也将引起转股价格的变动，对转债价格产生不同影响，本基金将充分挖掘各条款对可转债带来的投资机会。

⑤分阶段投资策略

由于各项条款的设置，在可转债存续的各个阶段，可转债的走势随市场变化会呈现出与股票市场同向或相对独立的规律。在转股期前，本基金将更关注可转债的期权性质，通过比较隐含波动率与历史波动率分析可转债估值的合理性，进而做出相应的投资决策。转股期内，本基金将更关注正股基本面变化、可转债的转股溢价率以及其提前赎回条款触发进程，投资于正股基本面良好、转股溢价率相对较低的可转债；当可转债触发提前赎回条款后，本基金将视情况决定卖出债券或转换为股票。

⑥低风险套利策略

在转股期内，可转债可以按照约定的价格转换为普通股，因此在交易过程中将出现可转债与正股之间的套利机会。当转股溢价率明显为负时，买入可转债的同时卖出相应数量正股可以获得价差收入；当转股溢价率明显为正时，买入正股的同时卖出可转债也可以获得套利价差。因此，在日常交易中，本基金将密切关注可转债与正股之间的对比关系，适时进行套利交易，增强基金组合收益。

⑦分离交易可转债投资策略

分离交易可转债是一种附认股权证的公司债，上市后债券部分与认股权证部分实行分离交易。在分离交易可转债纯债方面，本基金将综合分析其信用状况、流动性以及与利率产品的利差，以及未来市场利率走势，在此基础上评估分离交易可转债的投资价值，并作出相应的投资决策；分离交易可转债的认股权证，本基金将利用权证定价模型分析其合理定价，结合对应正股判断在其上市后继续持有或卖出。

3、信用债投资策略

本基金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，对债券进行信用评级，在此基础上，建立信用类债券池；在目标久期确定的基础上，积极发掘信用风险利差具有相对投资机会的个券进行投资。在控制风险的基础上，基金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。

①宏观研究

宏观经济的前瞻性研究，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行业研究

不同行业的企业所处的周期和行业竞争态势存在差异，通过对行业进行研究，进行行业配置，分散行业风险。行业基本特征，比如在国家产业中的地位、行业发展周期、上下游行业相关性、行业集中度、竞争程度、进入壁垒、产业政策以及发展趋势都会直接影响公司的经营状况和发展空间。

对行业评价的因素主要包括：行业竞争力、行业供求和影响需求的长期趋势、行业发展阶段、交易环境、法律与监管框架、行业重构、行业市场结构、技术变化、财务指标和对宏观经济环境和政策的敏感程度。

③公司研究

公司的研究主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、管理水平和管理层素质、未来发展战略、投资计划、股东或地方政府的实力以及支持力度等。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、管理水平、财务状况等因素后，结合具体发行契约，对债券进行内部信用评级。内外部评级的差别与经济周期的变化、信用等级的升降都会造成利差的改变。此外，内部通过对发行人财报数据的持续跟踪和迁移分析寻找引起信用水平变化的主要因素，对于可能调整评级的债券密切关注，可以通过内外部评级、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。

4、其他债券投资策略

①目标久期策略

基于对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，确定债券组合平均剩余期限。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

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。

③相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债或企业债之间的信用利差、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。

④杠杆乘策略

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。

⑤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。

⑥中小企业私募债投资策略

中小企业私募债具有票息收益高、信用风险高、流动性差、规模小等特点。短期内，中小企业私募债对本基金的贡献有限，但本基金将在市场条件允许的情况下进行择优投资。由于中小企业私募债的发行主体多为非上市民营企业，个体异质性强、信息少且透明度低，因此在投资研究方面主要采用逐案分析的方法（case-by-case），通过尽职调查进行独立评估，信用分析以经营风险、财务风险和回收率（recovery rate）等指标为重点。此外，针对中小企业私募债的投资，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

⑦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，选择经风险收益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。

九、基金的业绩比较基准

天相可转债指数收益率×40%+中债企业债总指数收益率×40%+中债国债总指数收益率×20%。

天相可转债指数是由天相投资顾问有限公司编制并发布的反映沪深两市可转债总体走势的指数，而中债企业债总指数和中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制、反映我国企业债和国债市场整体价格和投资回报情况的指数。这三只指数具有较强的权威性和市场代表性，能够反映我国可转债、企业债和国债市场的总体走势。

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的指数时，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权威。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报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中中等风险的品种，其预期的风险收益水平低于股票基金和混合基金，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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月16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2015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	8,591,854.36	1.98
	其中：股票	8,591,854.36	1.98
2	固定收益投资	406,306,895.00	93.63
	其中：债券	406,306,895.00	93.63
	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	7,044,602.66	1.62
7	其他资产	11,996,054.68	2.76
8	合计	433,939,406.70	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	-	-
C	制造业	2,897,547.16	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,694,307.20	2.36
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	8,591,854.36	3.57

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	72,780	5,694,307.20	2.36
2	002391	长青股份	148,516	2,897,547.16	1.20

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	10,004,000.00	4.15
	其中：政策性金融债	10,004,000.00	4.15
4	企业债券	201,173,243.00	83.50
5	企业短期融资券	130,119,000.00	54.01
6	中期票据	31,156,000.00	12.93
7	可转债	33,854,652.00	14.05
8	其他	-	-
9	合计	406,306,895.00	168.64

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	124399	13郫高科	270,000	28,117,800.00	11.67
2	101360018	13乌城投MTN001	200,000	20,828,000.00	8.64
3	122295	13川投01	200,000	20,776,000.00	8.62
4	124377	13渝磁城	200,000	20,712,000.00	8.60
5	112190	11亚迪02	200,000	20,688,000.00	8.59

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 报告期内，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。

11.2 本基金投资的前十名股票中，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	44,981.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,708,218.70
5	应收申购款	4,242,854.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,996,054.68

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	110011	歌华转债	10,107,552.00	4.20
2	110023	民生转债	5,490,800.00	2.28

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。

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2014年12月31日）

1.华安双债添利债券A

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2013-6-14（合同生效日）至2013-12-31	-2.40%	0.24%	-5.39%	0.28%	2.99%	-0.04%
自2014-1-1至2014-12-31	25.82%	0.42%	26.21%	0.43%	-0.39%	-0.01%

2.华安双债添利债券B

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2013-6-14（合同生效日）至2013-12-31	-2.60%	0.24%	-5.39%	0.28%	2.79%	-0.04%
自2014-1-1至2014-12-31	26.18%	0.42%	26.21%	0.43%	-0.03%	-0.01%

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0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.7%÷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5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、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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5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、申购费

本基金A类基金份额在投资者申购时收取申购费，C类基金份额不收取申购费。

本基金对通过直销机构申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过直销机构申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

其它投资者申购本基金A类基金份额的申购费率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。具体费率如下表所示：

份额类型	申购费率（单笔申购金额M）	
A类基金份额	M<100万	0.8%
	100万≤M<300万	0.5%
	300万≤M<500万	0.3%
	M≥500万	每笔1000元
C类基金份额	0	

申购费用由申购本基金A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费用

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，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于收取的持续持有期少于30日的投资人的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产；对于收取的持续持有期大于等于30日的投资人的赎回费，基金管理人将不低于其总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金赎回费率随申请份额持有时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

份额类型	赎回费率（持有期限Y）	
A类基金份额	Y<30天	0.75%
	30天≤Y<1年	0.1%
	1年≤Y<2年	0.05%
	Y≥2年	0
C类基金份额	Y<30天	0.75%
	Y≥30天	0

其中，1年为365天，2年为730天，以此类推。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.35%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.35%÷当年天数

H为本基金C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为本基金C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月前5个工作日内从基金财产中划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

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×转出基金当日基金份额净值×转出基金赎回费率

转出基金额=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））×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、仲裁费和诉讼费；

3、基金份额持有人大会费用；

4、基金的证券交易费用；

5、基金的银行汇划费用；

6、基金的开户费用、账户维护费用；

7、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参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（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；

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）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

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、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

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

章节	主要更新内容
重要提示	更新了重要提示的相关内容。
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	更新了部分直销以及代销机构的信息。
八、基金份额的申购、赎回与转换	调整了单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制。
九、基金的投资	更新了基金投资组合报告至2015年3月31日，详见招募说明书。
十、基金的业绩	按篇了基金合同生效以来至2014年12月31日的基金业绩，详见招募说明书。
二十一、对基金投资人的服务	更新了对账单规则、短信及资讯服务的内容，更新电子直销渠道的支持银行及支持业务的更新，详见招募说明书。
二十二、其他应披露事项	按篇了自2014年12月14日至2015年6月14日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一五年七月二十九日

证券简称:上海电力　证券代码:600021　编号:临2015-40

上海电力股份有限公司 关联交易公告

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。

重要内容提示

◆交易内容:上海电力股份有限公司(以下简称"公司")拟委托中电投信息技术有限公司(以下简称"信息公司")开展ERP系统建设项目管理服务。

◆关联人回避事宜:本次关联交易经公司2015年第五次临时董事会批准,与该关联交易有利害关系的关联董事已对该项议案的表决进行了回避。

◆交易对上市公司的影响:公司ERP项目完成后,通过ERP系统作为管理工具可实现对公司生产经营活动中各种资源信息的有序收集、汇总、整理和反馈,实现业务流、资金流、物资流、人才流、信息流的有效集成,达到资源的有效配置和最优利用,最终实现提升企业价值和精益管理的目标。

根据《上海证券交易所股票上市规则》的有关规定,现将有关事项公告如下:

一、交易概述

经公司2015年第五次临时董事会批准,同意公司委托中电投信息技术有限公司(以下简称"信息公司")开展ERP系统建设项目管理服务,并签订相关合同文件以及办理相关手续。

鉴于信息公司为本公司控股股东国家电力投资集团公司之全资子公司,根据《上海证券交易所股票上市规则》的有关规定,信息公司和本公司为同一实际控制人下的关联公司,本次交易构成关联交易。为保证董事会所形成决议的合法性,公司7名关联方董事回避了该项议案的表决,由其他7名非关联方董事进行表决,7票同意,0票反对,0票弃权。

二、关联方中电投信息公司工程有限公司基本情况

中电投信息技术有限公司成立于2013年8月,其股东为国家电力投资集团公司。

注册资本:人民币伍仟万元整

注册地址:北京市昌平区科技园区创新路7号1号楼2106号

企业法人代表人:吴锡林

经营范围:信息系统集成、实施和运维服务;软件设计、开发;数据处理及存储业务;管理咨询,信息咨询,技术咨询,技术培训,技术服务,技术转让;物联网服务,电子商务服务;网络、通信、智能化、自动化系统工程研发、设计;信息安全工程研发、设计;计算机、自动化及智能化系统软件、硬件及相关外设设备、信息安全产品、网络设备的生产、销售和代理,工业控制系统设备、通讯设备及电子产品的销售和代理;IT外包服务,与信息化相关的招标代理服务;进出口业务;广告业务;设备租赁。

截至2014年12月底,信息公司总资产7374.18万元,归属于母公司股东的所有者权益5028.36万元;2014年1-12月营业总收入7183.81万元,归属于母公司股东的净利润37.28万元。

三、关联交易标的情况

公司ERP项目(以下简称"项目")拟委托中电投信息公司作为项目管理方。双方拟签定项目建设管理服务框架协议(以下简称"框架协议"),协议覆盖2015年-2017年上海电力ERP项目建设管理服务,协议服务费用为629.44万元。其中2015年项目管理服务费用为246.31万元,2016年项目管理服务费用为212.85万元,2017年项目管理服务费用为170.28万元。

四、关联交易的主要内容和定价政策

1、主要内容

信息公司作为公司ERP推广项目的项目管理方,主要为公司提供以下服务内容:

提供ERP系统一期、二期建设部分解决方案及建设成果,包括模块开发成果,接口方案及代码;提供项目实施标准和规范,并提供必要的技术支持和服务;协助联系服务系统原厂商,并就项目实施中的重大技术问题进行统一协调、统一规划;对项目实施过程中的重大问题和项目实施风险提出合理化建议;协调集中部署的各管控应用系统之间的接口;受公司委托,协助组织对项目进度、质量、风险等进行检查、监督并做好考核相关配合工作;组织对上海电力ERP系统二期建设项目成果的验收和评价,并为系统运维工作提供指导和帮助。

2、定价原则

本次交易是依据所提供项目管理服务的工作内容参考同类项目市场价格确定。

五、本次关联交易的目的以及对公司的影响

上海电力ERP项目完成后，通过ERP系统作为管理工具可实现对公司生产经营活动中各种资源信息的有序收集、汇总、整理和反馈,实现业务流、资金流、物资流、人才流、信息流的有效集成,达到资源的有效配置和最优利用,最终实现提升企业价值和精益管理的目标。

六、独立董事意见

公司独立董事一致认为,本次关联交易的决策程序符合有关法律法规和《公司章程》的规定,交易价格客观公允,交易条件公平、合理。公司董事会审议此事项时,关联董事已全部回避,表决程序合法有效,不存在损害上市公司及全体股东利益的情形。

上海电力ERP项目完成后，通过ERP系统作为管理工具可实现对公司生产经营活动中各种资源信息的有序收集、汇总、整理和反馈,实现业务流、资金流、物资流、人才流、信息流的有效集成,达到资源的有效配置和最优利用,最终实现提升企业价值和精益管理的目标。

七、备查文件

1、上海电力股份有限公司2015年第五次临时董事会决议

2、上海电力股份有限公司独立董事就关联交易事项的意见函

特此公告。

上海电力股份有限公司
董事会
二〇一五年七月二十九日

证券简称:上海电力　证券代码:600021　编号:临2015-38

上海电力股份有限公司 2015年第五次临时董事会决议公告

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。

一、董事会会议召开情况

(一)上海电力股份有限公司2015年第五次临时董事会会