（上接B57版）

(88) 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
(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
电话:(0451)82336863
传真:(0451)82287211
客户服务电话:40066-62288
网址:www.jhzq.com.cn
(90) 国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:(028)86690125
传真:(028)86690126
客户服务电话:4006-600109
网址:www.gjzq.com.cn
(91) 华证证券有限责任公司
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
(92) 厦门证券有限公司
注册地址:厦门莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
电话:(0592)5161642
传真:(0592)5161140
客户服务电话:(0592)5163588
网址:www.xmzq.cn
(93) 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:钱华
电话:(021)32229888
传真:(021)62878701
客户服务电话:4001962502
网址:www.ajzq.com
(94) 恒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十一、三十九、三十、三十一层
法定代表人:吴骏
电话:(0755)83007041/ 83007166
传真:(0755)83007034
客户服务电话:(0755)26982993
网址:www.ydsc.com.cn
(95) 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:祝健忠
电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客户服务电话:58568118
网址:www.hrsec.com.cn
(96) 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
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
(97) 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:武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座37楼
法定代表人:余益
电话:(027)87618889
传真:(027)87618863
客户服务电话:(028)86712334
网址:www.tfzq.com
(98) 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:马功勋
电话:(024)23266917
传真:(024)23255606
客户服务电话:4006180315
网址:www.stockrcn.com
(99) 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38、39层
办公地址: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38、39层
法定代表人:李红光
电话:(0411)39673301
传真:(0411)39673219
客户服务电话:4008-169-169
网址:www.estock.com.cn
(100) 上海华信证券有限责任公司
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:杨锐敏
电话:(021)38784818
传真:(021)68775878
客户服务电话:(021)38784818
公司网站:http://www.shhzq.com
(101) 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:021-68569516?
网址: www.ehowbuy.com
(102) 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楼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
(103) 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
(104) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:浦东新区浦翔路526号2幢220室
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
法定代表人:张跃伟
电话:021-58788678
客户服务电话:400-820-2899
网址: www.erich.com.cn
(105) 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:021-38600676
传真:021-38509777
网址: www.noah-fund.com
(106) 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:易峥
客服电话:0571-88920897 4008-773-772
传真:0571-86800423
公司网站: www.5ifund.com
(107) 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
客服电话:400-888-6661
传真:(+86-10)62020088-8802
网址:www.myfp.cn
(108) 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:010-59393923
传真:010-59393074(全客服电话:4008080069
网址:www.wy-fund.com
(109) 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1、J单元
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
网址:www.zlfund.cn www.jimmw.com
(1) 联讯证券股份有限公司
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
客服电话:95564
网址:www.lxzq.com.cn
(2) 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:王荣
电话:021-20835787
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
(3) 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:北京市朝阳区爱子庙西路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
(4) 深圳市新三板证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人:陈翼
客服电话:400-850-7771
公司网站:https://t.jrj.com/
(5) 北京增财基金销售有限公司
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:罗细安
客服电话:400-001-8811
公司网站:http://www.zcvc.com.cn
(6) 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
公司网站:http://www.tpyzq.com
(117) 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
(118) 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号中国中期大厦A座11层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
法定代表人: 路翔
电话:010-59539718,59539728
传真:010-65807110
客服电话: 95162,4008888160
网址: www.cifcofund.com
(119) 上海证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:张益
联系电话:021-33323998
传真号码:021-33323993
客服电话: 400-820-2819
网址: fund.bundtrade.com
(120) 泉州银行股份有限公司
注册地址:泉州市云鹿路3号
办公地址:泉州市云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系电话:0595-22551071
传真号码:0595-22505215
(121) 一路财富(北京)信息科技有限公司
地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
客服电话:4000011566
网址:www.yilucaifu.com
乙方:北京恒天明泽基金销售有限公司
地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
客服电话:4008980618
网址:www.chrfund.com/
(122) 北京恒天明泽基金销售有限公司
地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
客服电话:4008980618
网址:www.chrfund.com/
(123) 海银基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
法定代表人:刘惠
联系电话:021-80133888
传真号码:021-80133413
客服电话: 400-808-1016
网址: http://www.fundhaiyin.com
(124) 上海陆家嘴国际金融资产交易市场股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号13楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号13-15楼
法定代表人:GIBB GEOFFREY DEAN
客户服务电话: 4008 6666 18
网址: https://www.lu.com/
(125) 东亚银行(中国)有限公司
注册地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
办公地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦29楼
法定代表人:李国宝
电话:021-38663866
传真:021-38663966
客户服务电话:8008303811
网址:www.hkbea.com.cn
(二)法定登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所: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: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
(二)律师事务所和经办律师
律师事务所: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: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:周祎
经办会计师:汪键、周祎

本基金名称:华安强化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

在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过增强信用产品的投资,以获取资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金为债券型基金,投资范围为固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券等除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例应围不低于基金资产净值的80%,其中,金融债、企业(公司)债、短期融资券、可分离债券、资产支持证券等除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例应围不低于基金资产净值的30%;持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具,包括一级市场的新股申购或增发新股、因可转换转股或因权证行权所形成的股票、因持有股票所派发或送转股票与可分离债券一级市场申购而产生的权证、二级市场股票等法律法规或监管机构允许投资的其他非固定收益类品种,本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的20%。

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

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,并利用公司研究开发的各种数量模型工具,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、二级市场股票之间的配置比例。

2.债券投资策略

(1)久期管理策略

通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,预测未来市场利率走势的变化,结合基金未来现金流,确定投资组合的目标久期,原则上,预期未来利率上升,可以通过缩短目标久期规避利率风险;相反,预期未来利率下降,则延长目标久期来获取债券价格上涨的超额收益。

(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立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)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。

(5)信用类债券投资策略

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。管理人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。

(6)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。

(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。

3.股票投资策略

(1)新股申购投资策略

参照目前国内其他金融品种的投资收益,我们认为参与新股投资将是低风险、高收益的投资品种之一。本基金作为固定收益类产品,将在充分依靠公司研究平台和投票估值体系、深入发掘新股内在价值的前提下,积极参与新股的申购。

(2)股票二级市场投资策略

本基金可适当参与股票二级市场投资,增强基金资产收益。本基金股票投资部分将重点投资于具有持续分红特征的股票,该类股票一般是指具有良好稳定的分红政策和意愿、持续良好的盈利及分红能力的上市公司。

本基金将采取"自下而上"的方式精选个股,选取过去两年连续现金分红且现金股息率(税后)均大于0的上市公司形成备选库,在此基础上,对于财务选库的股票,本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征,同时综合利用市盈率(P/E)、市净率(P/B)和折现现金流(DCF)等价值方法对公司的投资价值进行分析和比较,挖掘具备中长期持续增长或阶段性高速成长,且股票估值水平偏低的上市公司来构建本基金的核心股票。

4.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。

5.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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%

中国债券综合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,其样本范围覆盖银行间市场和交易所市场,样本券包括国家债券、央行票据、金融债、短期融资券、企业债、公司债等所有主要债券种类,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金债券投资部分的业绩比较基准。

中证红利指数是由中证指数有限公司编制,挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势,适合作为本基金股票投资部分的业绩比较基准。

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,或者基准市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以与基金托管人协商一致后报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金为债券型基金,基金的风险与预期收益都要低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低等风险和中低等收益品种。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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9月30日。

2.基金投资组合报告

2.1 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	3,962,100.00	1.15
	其中:股票	3,962,100.00	1.15
2	固定收益投资	306,987,387.10	88.87
	其中:债券	306,987,387.10	88.87
	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	9,900,134.85	2.87
	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	21,753,545.42	6.30
7	其他资产	2,831,517.09	0.82
8	合计	345,434,684.46	100.00

2.2 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	1,000,000.00	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	233,700.00	0.08
F	批发和零售业	1,032,400.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	480,000.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,216,000.00	0.42
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	3,962,100.00	1.38

2.3 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	601328	交通银行	200,000	1,216,000.00	0.42
2	600058	五矿发展	40,000	1,032,400.00	0.36
3	000018	中冠A	40,000	1,000,000.00	0.35
4	000796	易食股份	20,000	480,000.00	0.17
5	601618	中国中冶	30,000	233,700.00	0.08

2.4 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	501,000.00	0.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	34,842,400.00	12.14
	其中:政策性金融债	34,842,400.00	12.14
4	企业债券	71,606,987.10	24.95
5	企业短期融资券	190,211,000.00	66.28
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	9,826,000.00	3.42
9	其他	-	-
10	合计	306,987,387.10	106.97

2.5 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	150210	15国开10	200,000	20,808,000.00	7.25
2	011500038	15沪煤炭SCP001	200,000	20,074,000.00	6.99
3	071511008	15国信证券CP008	200,000	20,002,000.00	6.97
4	071530066	15万融证券CP006	200,000	20,000,000.00	6.97
5	132416	15PT民投债	100,000	10,168,000.00	3.54

2.6 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。

2.7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。

2.8 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。

2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2.9.1 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。

2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

2.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资国债期货。

2.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

2.11 投资组合报告附注

2.11.1 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,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。

2.11.2 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。

2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	99,848.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,487,467.76
5	应收申购款	244,200.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,831,517.09

2.11.4 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。

2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600058	五矿发展	1,032,400.00	0.36	筹划重大事项停牌
2	601618	中国中冶	233,700.00	0.08	重大事项停牌

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。

(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2015年6月30日)

华安强化收益债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至2009年12月31日	5.41%	0.32%	3.00%	0.22%	2.41%	0.10%
自2010年1月1日起至2010年12月31日止	5.84%	0.31%	-1.80%	0.16%	7.64%	0.15%
自2011年1月1日起至2011年12月31日止	-2.15%	0.21%	-0.20%	0.15%	-1.95%	0.06%
自2012年1月1日起至2012年12月31日止	8.03%	0.13%	1.04%	0.13%	6.99%	0.00%
自2013年1月1日起至2013年12月31日止	0.86%	0.24%	-4.39%	0.17%	5.25%	0.07%
自2014年1月1日起至2014年12月31日止	33.05%	0.81%	11.06%	0.16%	21.99%	0.65%
自2015年1月1日起至2015年6月30日止	19.93%	1.27%	5.92%	0.25%	14.01%	1.02%

华安强化收益债券B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至2009年12月31日	5.11%	0.32%	3.00%	0.22%	2.11%	0.10%
自2010年1月1日起至2010年12月31日止	5.46%	0.32%	-1.80%	0.16%	7.26%	0.16%
自2011年1月1日起至2011年12月31日止	-2.65%	0.21%	-0.20%	0.15%	-2.45%	0.06%
自2012年1月1日起至2012年12月31日止	7.61%	0.12%	1.04%	0.13%	6.57%	-0.01%
自2013年1月1日起至2013年12月31日止	0.48%	0.24%	-4.39%	0.17%	4.87%	0.07%
自2014年1月1日起至2014年12月31日止	32.45%	0.80%	11.06%	0.16%	21.39%	0.64%
自2015年1月1日起至2015年6月30日止	19.69%	1.27%	5.92%	0.25%	13.77%	1.02%

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2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2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。

3.销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,B类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。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B类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.4%÷当年天数

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类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2个工作日内从基金财产中划出,由注册登记机构收取,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。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购费

本基金的A类基金份额在申购时收取申购费,B类基金份额在申购时不收取申购费。

本基金A类基金份额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。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划等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。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

申购费率如下表所示:

费用种类	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
B类基金份额	0	

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

本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.3%,按持有期递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,赎回费总额的25%归基金财产,具体费率如下:

费用种类	赎回费率(持有期限Y)	
A类基金份额	Y<1年	0.1%
	1年≤Y<2年	0.05%
	Y≥2年	0
B类基金份额	Y<60天	0.3%
	Y≥60天	0

注:一年指365天,两年为730天。

3.转换费

开放基金份额持有人、基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的基金转换业务,基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

4.基金管理人可以调整6申购费率、赎回费率或收费方式,并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。

(三)其他费用

1.基金财产按时支付的银行费用;

2.基金合同生效后的信息披露费用;

3.基金份额持有人大会费用;

4.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

5.基金的证券交易费用;

6.按照国家有关规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

下列费用不列入基金费用:

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)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前21在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(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》、《公开募集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	对部分代销机构信息进行了更新。
八、基金份额的申购、赎回与转换	1更新了广州分公司、西安分公司、成都分公司的联系方式; 2调整了单笔最低申购金额。
十一、基金的投资	更新了最近一期基金投资组合报告。
十二、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	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。
二十四、其他应披露事项	披露了自2015年4月13日至2015年10月13日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一五年十一月二十七日

证券代码:002159 证券简称:三特索道 公告编号:临2015-63

武汉三特索道集团股份有限公司第九届董事会第二十二次临时会议决议公告

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

武汉三特索道集团股份有限公司第九届董事会第二十二次临时会议通知于2015年11月22日以传真、电子邮件、书面送达等方式发出。会议于2015年11月25日以通讯方式召开。会议由刘丹军董事长主持,应到董事9名,实到董事9名。公司监事会监事以通讯方式列席会议。本次董事会召集、召开程序符合《公司法》、公司章程、《董事会议事规则》的有关规定,会议决议合法有效。

经与会董事审议,会议对审议事项作出决议如下:

审议通过《关于神农架三特物业开发管理有限公司增加注册资本的议案》。

同意将本公司对神农架三特物业开发管理有限公司(以下简称"神农架物业")提供的往来款5,000万元转增为该子公司注册资本。转增后,神农架物业注册资本为6,000万元,本公司占比100%。

同意7票,反对0票,弃权0票

本次增资完成后,公司将对神农架物业进行资产重组。该项重组将涉及关联交易。根据深交所《股票上市规则》的有关规定,公司本次对神农架物业增资亦构成关联交易。关联董事郑文舫、王鸣回避了表决。

本次关联交易需提交股东大会审议。股东大会召开时间另行通知。

本次关联交易不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

详细内容见今日登载于《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》和