(上接B78版)

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦十一、二十九、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
(84) 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：祝献忠
电话：(010)58568007
传真：(010)58568062
客户服务电话：58568118
网址：www.hrsec.com.cn
(85) 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：余磊
电话：(027)87618889
传真：(027)87618863
客户服务电话：028-86712334
网址：www.tfzq.com
(86) 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.stockren.com
(87) 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或jijin.txsec.com
(88) 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
(89) 中国国际金融股份有限公司
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)65051156
客户服务电话：(010)65051166
网址：www.cicc.com.cn
(90) 中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
电话：(0755)23835383
传真：(010)60836029
客户服务电话：0755-23835888
网址：www.cs.ecitic.com
(91) 东北证券股份有限公司
注册地址：吉林省长春市自由大路1138号
办公地址：吉林省长春市自由大路1138号东北证券大厦
法定代表人：李福春
电话：(0431)85096806
传真：(0431)85096816
客户服务电话：95360
网址：www.nesc.cn
(92) 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：95345
网址：www.stocke.com.cn/zszq/index/index.jsp
(93) 平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路荣超大厦4036号16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路荣超大厦4036号16-20层
法定代表人：谢永林
电话：4008866338
传真：(0755)82400862
客户服务电话：95511-8
网址：stock.pingan.com
(94) 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
(95) 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)63577930
网址：www.hongtazq.com
(96) 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：http://www.ajzq.com/common/index.jsp
(97) 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
(98) 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：陈海平
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：http://www.shhxzq.com
(99) 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：0571-95336
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
传真：021-58787698
客户服务电话：400-820-2899
网址：www.e-rich.com.cn
(104) 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
客服电话：8008303811
网址：www.hkbea.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
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
(106) 北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
电话：400-888-6661
传真：(+86-10)62020088-8802
客户服务电话：4008886661
网址：www.myfp.cn
(107) 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：路瑶
电话：010-59539718、59539728
传真：010-65807110
客户服务电话：95162、400-8888-160
网址：www.cifcofund.com
(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号院盘古大观A座3201
法定代表人：李招弟
电话：010-59393923
传真：010-59393074
客户服务电话：400-808-0069
网址：www.wy-fund.com
(109) 深圳众禄金融控股股份有限公司
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：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
电话：4006-788-887
传真：0755-82080798
网址：www.zlfund.cn ，www.jjmmw.com
(110) 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
电话：0571-88920879
传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772　0571-88920897
网址：www.5ifund.com
(111) 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：http://www.lxsec.com
(112) 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
联系人：吴卫东
电话：021-20835787
传真：021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
(113) 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
(114) 深圳市新兰德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：陈操
电话:(010)58325395
传真:(010)58325282
客服电话：400-850-7771
公司网站：https://t.jrj.com/
(115) 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
(116) 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
(117) 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
(118) 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
(119) 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.chtfund.com/
(120) 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
客户服务电话：400-808-1016
网址：http://www.fundhaiyin.com
(121) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
联系电话：021-20665952
传真号码：021-22066653
(122) 北京乐融多源投资咨询有限公司
地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人：董浩
客户服务电话:400-068-1176
网址：www.jimufund.com
(123) 上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
客户服务电话：400-046-6788
网址：www.66zichan.com
(124) 深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
客户服务电话:0755-83999913
网址：www.jinqianwo.cn
(125) 北京乐融多源投资咨询有限公司
地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人：董浩
客户服务电话：400-068-1176
网址：www.jimufund.com
(126) 大泰金石投资管理有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人：袁顾明
联系电话：021-22267987
传真号码：021-22268089
网址：www.dtfunds.com/
(127) 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道1号宝利国际广场南塔12楼
法定代表人：肖雯
联系电话：020-89629021
传真号码：020-89629011
(128) 宏信证券宏信证券有限责任公司
注册地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
办公地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人：吴玉明
客服电话：4008-366-366
(129) 上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
联系电话：86-021-50583533
传真号码：86-021-50583633
客户服务电话：4000676266
(130) 北京君德汇富投资咨询有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人：李振
联系电话：65181028
传真号码：65174782、客户服务电话：400-066-9355
网站：www.kstreasure.com
(131) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
法定代表人：彭运年
客户服务电话：4008909998　　网址：www.jnlc.com
(132) 泰信财富投资管理有限公司
客户服务电话：400-168-7575
网址:www.taixincf.com
地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间
法定代表人：李静
(133) 上海凯石财富基金销售有限公司
地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人：陈继武
客户服务电话：4000 178 000
网址：www.lingxianfund.com
(134) 上海中正达广投资管理有限公司
地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
客户服务电话：400-6767-523
网址：www.zzwealth.cn
(135) 苏州银行股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号
办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号
法定代表人：王兰凤
联系电话：0512-65280149
传真号码：0512-69868370
(136) 北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人：赵荣春
联系电话：010-57418813
传真号码：010-57569671
(137) 北京格上富信投资顾问有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人：李悦章
联系电话：(010)65983311
传真号码：(010)65983333
(二)注册登记机构
名称：华安基金管理有限公司
住所：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期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)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(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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
联系电话：(021)23238888
传真：(021)23238800
联系人：周祎
经办会计师：单峰、周祎

四、基金的名称

本基金名称：华安稳定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

在严格控制投资风险的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益及市场价格变动收益，以追求资产持续稳健的增值。

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，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、信用等级为投资级的企业(公司)债，以及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。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%；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%；股票等权益类品种的投资比例为基金资产的0%-20%。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。

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，以确定基金资产的分配比例。

本基金对债券等固定收益类品种的投资比例占基金资产的80%-100%；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%；股票等权益类品种的投资比例占基金资产的0%-20%。

2、债券投资策略(不含可转债)

本基金为债券型基金，在投资过程中我们高度重视稳健投资策略的运用。通过宏观层面自上而下的分析，把握宏观经济基本态势和市场利率波动趋势，及时调整组合的平均剩余期限，使基金资产获得稳定的较高收益。

本基金构建债券组合时，将具体采取利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、替代互换选择策略和骑乘策略等积极投资策略，发现、确认并利用市场中存在的机会，实现组合稳定增值。同时，将根据组合流动性情况调整个券投资，保证核心债券组合的流动性。为了严格控制投资风险，本基金将谨慎地投资信用等级为投资级的企业(公司)债。

(1)利率预期策略

该策略是基于对未来利率走势的预测，改变组合平均剩余期限，以适应利率变化。本策略主要是基于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，确定投资组合平均剩余期限。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

该策略是通过市场收益率曲线形状的变化来调整组合结构的策略，具体包括子弹策略、两极策略和梯式策略三种。按子弹策略构建的投资组合目的是为了使组合中证券的到期集中在收益率曲线的一点；两极策略则是将证券的到期期限集中于两极；梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。

(3)收益率利差策略

该策略是基于不同债券市场板块间利差而在组合中分配资本的方法。收益率利差包括信用利差、可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差等表现形式。信用利差存在于不同债券市场，如国债和企业债利差、国债与金融债利差、金融债和企业债利差等；可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差形成的原因是基于利率预期的变动。

(4)替代互换选择策略

这是以一种息票利率、期限、信用质量都相同，但收益率要略高的债券来更换组合中的债券。这种互换依赖于资本市场的不完善，这种情况的出现一般存在暂时性。

(5)骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度，如果收益率曲线较为陡峭，则骑乘策略运用的可行性就增大，该策略的运用可以获得较高的资本利得；反之，如果收益率曲线比较平坦，则骑乘策略运用的空间就较窄，获得资本利得的可能性降低。

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

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最具有低风险、高收益的投资品种之一。同时，随着股改完成，预计我国证券市场在未来仍将保持一定数量与规模的新股发行。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股票估值体系、深入发掘新股内在价值的前提下，积极参与新股的申购。

九、基金的业绩比较基准

中国债券总指数。

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。

将来如有更合适的指数推出，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构成。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，并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票基金、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016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2016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	2,984,598,915.50	92.13
	其中：债券	2,984,598,915.50	92.13
	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	150,000,275.00	4.63
	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	53,142,354.75	1.64
7	其他各项资产	51,821,614.01	1.60
8	合计	3,239,563,159.26	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	149,077,422.00	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	308,444,000.00	12.57
	其中：政策性金融债	308,444,000.00	12.57
4	企业债券	716,447,905.50	29.20
5	企业短期融资券	1,214,929,000.00	49.51
6	中期票据	486,689,000.00	19.83
7	可转债	109,011,588.00	4.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,984,598,915.50	121.63

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	150218	15国开18	2,200,000	228,338,000.00	9.31
2	150023	15附息国债23	1,000,000	101,010,000.00	4.12
3	132004	15国盛EB	1,000,000	99,990,000.00	4.07
4	041560115	15长电科技CP004	600,000	60,420,000.00	2.46
5	113009	广汽转债	500,000	59,885,000.00	2.44

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投资。

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,802.19
2	应收证券清算款	5,410,211.30
3	应收股利	-
4	应收利息	45,050,986.92
5	应收申购款	1,346,613.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,821,614.01

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。

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。

(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2015年12月31日)

1、华安收益A类基金：

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
2015年度	10.80%	0.34%	8.02%	0.11%	2.78%	0.23%
2014年度	26.78%	0.39%	11.23%	0.15%	15.55%	0.24%
2013年度	-2.55%	0.24%	-2.10%	0.11%	-0.45%	0.13%
2012年度	6.53%	0.10%	2.51%	0.07%	4.02%	0.03%
2011年度	-1.29%	0.28%	5.72%	0.11%	-7.01%	0.17%
2010年度	8.73%	0.28%	1.92%	0.10%	6.81%	0.18%
2009年度	3.79%	0.29%	-1.24%	0.10%	5.03%	0.19%
自基金合同生效日(2008年4月30日)起至2008年12月31日	9.53%	0.15%	11.25%	0.24%	-1.72%	-0.09%

2、华安收益B类基金：

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
2015年度	10.36%	0.34%	8.02%	0.11%	2.34%	0.23%
2014年度	26.25%	0.39%	11.23%	0.15%	15.02%	0.24%
2013年度	-2.93%	0.24%	-2.10%	0.11%	-0.83%	0.13%
2012年度	6.08%	0.10%	2.51%	0.07%	3.57%	0.03%
2011年度	-1.58%	0.28%	5.72%	0.11%	-7.30%	0.17%
2010年度	8.35%	0.28%	1.92%	0.10%	6.43%	0.18%
2009年度	3.33%	0.29%	-1.24%	0.10%	4.57%	0.19%
自基金合同生效日(2008年4月30日)起至2008年12月31日	9.21%	0.15%	11.25%	0.24%	-2.04%	-0.09%

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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为0.6%

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.2%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，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×年销售服务费率÷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首日起3个工作日内从基金资产中划出，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。

(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。

A类基金份额收费模式下

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。

其他投资人申购本基金基金份额申购费率如下所示：

(1)投资者选择交纳前端申购费，申购费按申购金额采用比例费率。本基金最高申购费率不超过0.8%，投资人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：

申请金额(M)	费率
M<100万	0.80%
100万≤M<500万	0.50%
500万≤M<1000万	0.30%
M≥1000万	每笔1000元

(2)投资者选择交纳后端申购费，申购费率按持有时间递减，申购费率见下表：

持有期限Y	后端申购费率
Y<1年	1.00%
1年≤Y<2年	0.80%
2年≤Y<3年	0.60%
3年≤Y<4年	0.40%
4年≤Y<5年	0.20%
Y≥5年	0.00

注：一年指365天，两年为730天，依此类推。

B类基金份额收费模式下

具体费率如下：

申请金额(M)	费率
全部	0.00%

本基金的申购费用由投资人承担并应在投资人申购基金份额时收取，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。

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，在投资者赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取的赎回费总额的25%归入基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。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<30天	0.3%
	30天≤Y<1年	0.1%
	1年≤Y<2年	0.05%
	Y≥2年	0%
B类基金份额	Y<30天	0.3%
	Y≥30天	0%

注：一年指365天，两年为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、基金财产拨划支付的银行费用；

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

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)费用调整

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和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，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2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，根据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》、《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	更新了基金管理人的相关信息。
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	对部分代销机构信息进行了更新。
九、基金的投资	更新了最近一期基金投资组合报告。
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	开通的基金电子直销交易资金结算的第三方支付渠道已更新，详见招募说明书。
二十二、其他应披露事项	披露了自2015年10月30日至2016年4月30日期间本基金的公告信息，详见招募说明书。

华安基金管理有限公司
二〇一六年六月十四日

证券代码：000034　　证券简称：神州数码　　公告编号：2016-086

神州数码集团股份有限公司2016年度第五次临时股东大会决议公告

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。

一、会议召开和出席情况

(一)会议召开情况

1、召开时间：

(1)现场会议召开时间：2016年6月13日(星期一)下午14:30

(2)网络投票时间为：2016年6月12日-2016年6月13日

其中，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：2016年6月13日，上午9:30-11:30，下午13:00-15:00；通过深圳证券交易所互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn)投票的具体时间为：2016年6月12日15:00至2016年6月13日15:00期间的任意时间。

2、现场会议召开地点：北京市海淀区北正黄旗59号世纪金源香山商旅酒店首长接见厅(香山公园东门外)。

3、召开方式：现场表决与网络投票相结合的表决方式

4、召集人：神州数码集团股份有限公司董事会

5、主持人：董事闫国荣先生

6、本次会议的通知于2016年5月26日发出，会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

(二)会议出席情况

1、出席的总体情况

出席本次股东大会现场会议和网络投票的股东及股东授权代表共21人，代表股份298,049,471股，占公司有表决权股份总数的在45.5684%。

2、现场会议出席情况

出席本次股东大会现场会议的股东及股东授权代表共3人，代表股份 297,687,771股，占公司有表决权股份总数的45.5131%。

3、网络投票情况

出席本次股东大会网络投票的股东18人，代表股份361,700股，占公司有表决权股份总数的0.0553%。

4、委托独立董事投票情况

本次会议没有股东委托独立董事进行投票。

5、中小投资者(指除公司董事、监事、高级管理人员以及单独或者合计持有公司5%以上股份的股东以外的其他股东，下同)出席情况

出席本次股东大会的中小投资者的股东及股东授权代表共18人，代表股份361,700股，占公司有表决权股份总数的0.0553%。

6、公司部分董事、监事、高级管理人员及公司聘请的见证律师出席或列席了本次股东大会。

二、议案审议和表决情况

本次股东大会议案采用现场投票与网络投票表决相结合的表决方式，会议审议通过了以下议案：

(一)审议通过了《关于变更公司经营范围的议案》

1、总体表决情况

同意297,900,571股，占出席会议有表决权股东所持股份的99.9500%；反对0股，占出席会议有表决权股东所持股份的0.0000%；弃权148,900股(其中，因未投票默认弃权132,700股)，占出席会议有表决权股东所持股份的0.0500%。

2、中小股东总表决情况：

同意212,800股，占出席会议中小股东所持股份的58.8333%；反对0股，占出席会议中小股东所持股份的0.0000%；弃权148,900股(其中，因未投票默认弃权132,700股)，占出席会议中小股东所持股份的41.1667%。

3、表决结果：本议案以特别决议审议通过。

(二)审议通过了《关于变更公司注册地址的议案》

1、总体表决情况

同意297,900,571股，占出席会议有表决权股东所持股份的99.9500%；反对0股，占出席会议有表决权股东所持股份的0.0000%；弃权148,900股(其中，因未投票默认弃权132,700股)，占出席会议有表决权股东所持股份的0.0500%。

2、中小股东总表决情况：

同意212,800股，占出席会议中小股东所持股份的58.8333%；反对0股，占出席会议中小股东所持股份的0.0000%；弃权148,900股(其中，因未投票默认弃权132,700股)，占出席会议中小股东所持股份的41.1667%。

3、表决结果：本议案以特别决议审议通过。

(三)审议通过了《关于使用自有资金进行证券投资的议案》

1、总表决情况：

同意143,271,668股，占出席会议所有股东所持股份的99.8619%；反对162,700股，占出席会议中小股东所持股份的0.1136%；弃权35,200股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议中小股东所持股份的0.0246%。

2、中小股东总表决情况：

同意163,800股，占出席会议中小股东所持股份的45.2861%；反对162,700股，占出席会议中小股东所持股份的44.9820%；弃权35,200股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议中小股东所持股份的9.7318%。

3、表决结果：本议案以特别决议审议通过。

三、律师出具的法律意见

1、律师事务所名称：北京市金杜律师事务所

2、律师姓名：龚牧龙、王蓬翠

3、结论性意见：本次股东大会的召集、召开程序、现场出席会议人员的资格、召集人资格及表决程序均符合《公司法》等法律、行政法规、《股东大会规则》和《公司章程》的规定；本次股东大会的表决程序、表决结果合法有效。

特此公告

神州数码集团股份有限公司
董事会
2016年6月13日

证券代码：000034　　证券简称：神州数码　　公告编号：2016-087

神州数码集团股份有限公司关于变更公司网站的公告

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。

为了便于投资者了解公司的相关信息，现将新的公司网站公告如下：

http://www.digitalchina.com

敬请广大投资者关注。

特此公告

神州数码集团股份有限公司
董事会
二零一六年六月十三日

证券代码：603779　　证券简称：威龙股份　　公告编号：2016-012

威龙葡萄酒股份有限公司第三届监事会第六次会议决议公告

本公司监事会及全体监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、监事会会议召开情况

威龙葡萄酒股份有限公司(以下简称"公司")第三届监事会第六次会议通知于2016年6月1日以书面通知、电子邮件、电话的形式向各位监事发出，会议于2016年6月12日上午08:00在公司会议室以现场表决的方式召开。本次会议应出席监事3人，实际出席监事3人。会议的召开符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》及有关法律、法规的规定。会议由监事会主席焦复润先生主持。

二、监事会会议审议情况

1、审议通过《关于使用部分闲置募集资金暂时补充流动资金的议案》

因公司募集资金到账日期晚于酿酒葡萄最佳种植时间(每年的4-5月份)，公司募集资金投资项目"1.8万亩有机酿酒葡萄种植项目"在2016年内不能全部实施，因而形成了该部分募集资金暂时闲置状况。为提高公司募集资金利用效率，公司拟使用"1.8万亩有机酿酒葡萄种植项目"中在2016年无法实施的部分闲置募集资金共计人民币9,000万元补充流动资金，使用期限自使用该募集资金之日起不超过十个月。

表决结果：3票同意，0票反对，0票弃权。

2、审议通过《关于对部分募集资金投资项目的投资优先顺序进行调整的议案》

自2014年4月20日，公司召开2013年度股东大会审议通过《关于公司首次公开发行股票募集资金投资项目可行性的议案》至今，国内葡萄酒市场环境发生了较大的变化.为了应对市场变化，增强公司盈利及抵御市场风险的能力，公司拟根据生产经营情况，对部分募集资金投资项目的投资优先顺序进行调整，根据轻重缓急拟用于以下4个项目：

(1)1.8万亩有机葡萄种植项目；

(2)偿还银行贷款；

(3)营销网络建设项目；

(4)4万吨有机葡萄酒生产项目。

表决结果：3票同意，0票反对，0票弃权。

本议案需提交股东大会审议

特此公告。

威龙葡萄酒股份有限公司
监事会
2016年6月13日

报备文件

(一)监事会决议

创金合信基金管理有限公司关于旗下基金增加定期定额投资业务代销机构的公告

为满足广大投资者的理财需求，向广大投资者提供更好的服务，创金合信基金管理有限公司(以下简称"本公司")经与相关代销机构协商，现决定自2016年06月14日起对我司旗下开放式基金创金合信鑫安保本混合型证券投资基金A(002565)、创金合信鑫安保本混合型证券投资基金C(002566)、创金合信量化多因子股票型证券投资基金(002210)增加下述的代销机构办理定期定额投资业务。

定期定额投资业务(以下简称"本业务")是指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。投资者在办理本业务的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。

一、新增定期定额投资业务代销机构

兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")，敬请广大投资者关注代销机构开通上述业务的公告或垂询有关代销机构。

兴业银行官方网站：www.cib.com.cn；

兴业银行客服热线：95561.

二、定期定额投资业务安排

1、投资者在开放日办理基金份额的定期定额投资业务，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

2、投资者需遵循各销售机构有关扣款日期的规定，并与销售机构约定每期扣款金额，具体的定期定额投资业务规则请参考各销售机构的相关规定。

3、投资者通过兴业银行进行定期定额投资，即通过兴业银行电子渠道(包括网上银行、电话银行、手机银行)开通基金定投业务的，定投申购费率统一优惠至0.6%，原申购费率低于0.6%或为固定费率的，按原费率执行。通过兴业银行柜面渠道开通基金定投业务的，享受基金定投申购费率八折优惠，优惠后申购费率不低于0.6%；如原费率低于0.6%，按原费率执行。(有关费率优惠的具体规定如有变化，敬请投资者留意前述代销机构的有关规定)。

4、定期定额投资业务的其它具体办理程序请遵循代销机构的有关规定。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金定期定额投资并不等于零存整取，不能规避基金投资所固有的风险，也不能保证投资者获得收益。敬请投资者投资基金时认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

创金合信基金管理有限公司
2016年06月14日