华安鼎丰债券型发起式证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

（2018年第1号）

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

二〇一八年一月

重要提示

华安鼎丰债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依照有关法律法规及约定发起,并经中国证券监督管理委员会2016年9月28日证监许可[2016]2223号文准予注册。本基金的基金合同和招募说明书已通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人的互联网网站(www.huaan.com.cn)进行了公开披露。本基金的基金合同自2016年11月30日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集申请的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险, 包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、技术风险、道德风险、合规风险、不可抗力风险等等。

本基金为债券型基金, 其预期的风险和预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金、高于货币市场型基金,属于证券投资基金中中等风险和收益的品种。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等自主判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,并自主做出投资决策,自行承担投资风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现, 基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金,基金销售机构名单详见本招募说明书以及相关公告。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2017年11月30日,有关财务数据截止日期为2017年9月30日,净值表现的截止日为2017年6月30日。

一、基金名称

本基金的名称:华安鼎丰债券型发起式证券投资基金。

二、基金的类型

本基金为债券型、发起式证券投资基金投资基金。运作方式契约型开放式。存续期限不定期。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:华安基金管理有限公司

2、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

3、办公地址: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

4、法定代表人:朱学华

5、设立日期:1998年6月4日

6、批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]20号

7、联系电话:(021)38969999

8、联系人:王艳

9、客户服务中心电话:40088-50099

10、网址:www.huaan.com.cn

(二)注册资本和股权结构

1、注册资本:1.5亿元人民币

2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
国泰君安创新投资有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员

(1)董事会

朱学华先生,本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生,博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限责任公司副总经理, 上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生,本科学历,高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记,上海东风机械(集团)公司总裁助理、副总裁,上海全光网络科技股份公司总经理,上海赛事商务有限公司总经理,上海东浩工艺品股份有限公司董事长,上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事,上海建筑材料(集团)总公司党委书记、董事长(法定代表人)、总裁。现任上海工业投资(集团)有限公司党委副书记、执行董事(法定代表人)、总裁。

马名驹先生,工商管理硕士,高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理,上海东方上市企业博览中心副总经理。现任锦江国际(集团)有限公司副总裁兼计划财务部经理及金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资产管理有限公司监事。

董鑑华先生,大学学历,高级经济师。历任上海市审计局基建处科员、副主任科员、处长助理、副处长,固定资产投资审计处副处长(主持工作)、处长,上海市审计局财政审计处处长,上海电气(集团)总公司财务总监,上海电气(集团)总公司副总裁、财务总监。现任上海电气(集团)总公司监事长,上海海立(集团)股份有限公司监事长,上海临港控股股份有限公司董事。

聂小刚先生,经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略管理部总经理。

独立董事:

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生,研究生学历,教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师,中国工业经济学会副会长,财政部会计准则委员会咨询专家,财政部企业内部控制标准委员会委员,香港中文大学名誉教授,复旦大学管理学院兼职教授,上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

(2)监事会

张志红女士,经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务,长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员,中小企业融资部总经理,国泰君安证券股份有限公司总裁助理、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司业务总监兼投行业务委员会副总裁,华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生,研究生学历。曾任怡安翰威特咨询业务总监,麦理根(McLagan)公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司人力资源部高级总监,华安资产管理(香港)有限公司董事。

诸慧女士,研究生学历,经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员,集中交易部总监助理。现任华安基金管理有限公司集中交易部总监。

(3)高级管理人员

朱学华先生,本科学历,18年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生,博士研究生学历,16年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理, 上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限责任公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士,研究生学历,17年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授,中国证监会上海证管办机构处副处长,中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

李邦长先生,硕士研究生,具有基金从业资格证书.曾任安永华明会计师事务所审计师,2010年3月加入华安基金管理有限公司,先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作,2014年9月起担任基金经理助理,2016年3月起担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2016年11月起,同时担任本基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度,公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

童　威先生,总经理

翁启森先生,总经理助理

杨　明先生,投资研究部高级总监

许之彦先生,指数与量化投资事业总部高级总监

贺　涛先生,固定收益部总监

苏圻涵先生,全球投资部助理总监

万建军先生,投资研究部联席总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况:

截至2017年9月30日,公司目前共有员工348人(不含香港公司),其中56.9%具有硕士及以上学位,89%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历, 具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

四、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人:牛锡明

住　　所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码:200120

注册时间:1987年3月30日

注册资本:742.62亿元

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号

联系人:陆志俊

电　话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第13位,较上年上升4位;根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第153位,较上年上升37位。

截至2017年9月30日,交通银行资产总额为人民币89357.90亿元。2017年1-9月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币544.19亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

牛锡明先生,董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长,2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生,副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事,2013年10月起任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

(三)基金托管业务经营情况

截至2017年9月30日,交通银行共托管证券投资基金319只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)华安基金管理有限公司上海业务部

地址: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

电话:(021)38969960

传真:(021)58406138

联系人:姚佳岑

(2)华安基金管理有限公司北京分公司

地址:北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室

电话:(010)57635999

传真:(010)66214061

联系人:刘雯

(3)华安基金管理有限公司广州分公司

地址:广州市天河区珠江西路8号高德置地夏广场D座504单元

电话:(020)38082891

传真:(020)38082079

联系人:林承壮

(4)华安基金管理有限公司西安分公司

地址:陕西省西安市高新区唐延路35号旺座现代城H座2503

电话:(029)87651812

传真:(029)87651820

联系人:翟均

(5)华安基金管理有限公司成都分公司

地址:成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L

电话:(028)85268583

传真:(028)85268827

联系人:张晓帆

(6)华安基金管理有限公司沈阳分公司

地址:沈阳市沈河区北站路59号财富中心E座2103室

电话:(024)22522733

传真:(024)22521633

联系人:杨贺

(7)华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站:www.huaan.com.cn

智能手机APP平台:iPhone交易客户端、Android交易客户端

华安电子交易热线:40088-50099

传真电话:(021)33626962

联系人:谢伯恩

2、代销机构

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。

(二)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)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

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、姜亚萍

(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号东方广场安永大楼16层

办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

首席合伙人:毛鞍宁

联系电话:(021)22288888

传真:(021)22280000

联系人:蒋燕华

经办会计师:蒋燕华、蔡玉芝

六、基金的投资目标

在一定程度上控制组合净值波动率的前提下, 力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金投资方向

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、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产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)。

本基金不参与股票、权证等权益类资产投资,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的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占基金资产净值的比例不低于5%。

八、基金的投资策略

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,动态调整大类资产配置比例,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,综合考量各类券种的流动性、供求关系、风险及收益率水平等,自下而上地精选个券。

(一)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, 以确定基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具之间的配置比例。

(二)利率类品种投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资,是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上, 运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测,深入分析利率品种的收益和风险,调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后,本基金对债券的期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,选择合适的期限结构的配置策略, 在合理控制风险的前提下, 综合考虑组合的流动性,决定投资品种。具体的利率品种投资策略如下:

(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)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)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。

(三)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。

(四)中小企业私募债券投资策略

除普通信用债外,本基金还将适时参与中小企业私募债券的投资。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,此类券种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。

(五)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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%。

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券资产的配置和个券的选择来增强债券投资的收益。中债综合指数(总财富)由中央国债登记结算有限责任公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场,具有广泛的市场代表性,适合作为市场债券投资收益的衡量标准;由于本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%, 采用90%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重,10%乘以1年定期银行存款利率(税后)作为资产所对应的权重可以较好的反映本基金的风险收益特征。

若未来法律法规发生变化,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, 或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布或更改名称,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金,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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2017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	305,099,718.40	96.86
	其中:债券	305,099,718.40	96.86
	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	5,648,179.67	1.79
7	其他各项资产	4,238,984.23	1.35
8	合计	314,986,882.30	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	40,046,000.00	16.89
	其中:政策性金融债	40,046,000.00	16.89
4	企业债券	109,613,218.40	46.23
5	企业短期融资券	30,156,000.00	12.72
6	中期票据	125,284,500.00	52.84
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	305,099,718.40	128.67

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	101575013	15中南建设MTN002	200,000	20,166,000.00	8.50
2	041760006	17大同煤矿CP001	200,000	20,108,000.00	8.48
3	170215	17国开15	200,000	20,086,000.00	8.47
4	112315	16宝龙债	200,000	20,082,000.00	8.47
5	101560029	15津华勘MTN001	200,000	20,062,000.00	8.46

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于股指期货。

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

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	5,010.51
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,233,973.72
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,238,984.23

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2017年6月30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
2017年1月1日至2017年6月30日	2.16%	0.04%	-0.02%	0.07%	2.18%	-0.03%
2016年11月30日至2016年12月31日	0.26%	0.04%	-1.15%	0.20%	1.41%	-0.16%

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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷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,于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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,于次月首日起5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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金在投资者申购时收取申购费。

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。

通过直销机构申购本基金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:

单笔申购金额(M)	申购费率
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

申购费用由申购本基金的投资人承担,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:

累计持有期间(Y)	赎回费率
Y<3个月	0.1%
Y≥3个月	0

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,并全部计入基金资产。

3、基金转换份额的计算

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:关于转换费用的其他相关条款请详见公司网站的有关临时公告。

4、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(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。上述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。

(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;

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
一、重要提示	更新了重要提示相关内容。
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。
九、基金的投资	更新了基金投资组合报告。
十、基金的业绩	披露了基金合同生效以来的基金业绩。
二十二、其他应披露事项	披露了自2017年5月30日至2017年11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

二〇一八年一月十三日

华安基金管理有限公司关于华安红利精选混合型证券投资基金增加广发证券股份有限公司销售机构的公告

根据华安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)签署的销售协议,自2018年1月15日起广发证券开始销售华安红利精选混合型证券投资基金(基金代码:005521)。投资者可在该基金的认购期内到广发证券办理基金认购等相关业务。

咨询办法

1、广发证券股份有限公司

网址: www.gf.com.cn

客户服务电话:95575

2、华安基金管理有限公司

客户服务电话:40088-50099

网址:www.huaan.com.cn

特此公告

华安基金管理有限公司

二〇一八年一月十三日

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年1月13日

1 公告基本信息

基金名称	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证龙头ETF
基金主代码	510190
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
离任基金经理姓名	牛勇
共同管理本基金的其他基金经理姓名	苏卿云

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	牛勇
离任原因	个人原因
离任日期	2018年1月15日
转任本公司其他工作岗位的说明	无
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

3其他需要说明的事项

本公司已将上述基金经理变更事项报中国证监会上海监管局备案。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2018年1月13日

华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年1月13日

1 公告基本信息

基金名称	华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金
基金简称	华安事件驱动量化策略混合
基金主代码	002179
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
离任基金经理姓名	牛勇
共同管理本基金的其他基金经理姓名	孙晨进

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	牛勇
离任原因	个人原因
离任日期	2018年1月15日
转任本公司其他工作岗位的说明	无
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

3其他需要说明的事项

本公司已将上述基金经理变更事项报中国证监会上海监管局备案。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2018年1月13日

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年1月13日

1 公告基本信息

基金名称	上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华安上证龙头ETF联接
基金主代码	040190
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
离任基金经理姓名	牛勇
共同管理本基金的其他基金经理姓名	苏卿云

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	牛勇
离任原因	个人原因
离任日期	2018年1月15日
转任本公司其他工作岗位的说明	无
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

3其他需要说明的事项

本公司已将上述基金经理变更事项报中国证监会上海监管局备案。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2018年1月13日

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年1月13日

1 公告基本信息

基金名称	华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
基金简称	华安中国A股增强指数
基金主代码	040002
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	兼有增聘与解聘基金经理
新任基金经理姓名	马韬
离任基金经理姓名	牛勇
共同管理本基金的其他基金经理姓名	许之彦

2新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	马韬
任职日期	2018年1月15日
证券从业年限	3年
证券投资管理从业年限	3年
过往从业经历	上海财经大学硕士研究生,曾任国泰君安证券股份有限公司研究员。2017年2月加入华安基金,担任指数与量化投资事业部数量分析师。
其中:管理过公募基金的名称及期间	基金主代码 / 基金名称 / 任职日期 / 离任日期 – / – / – / –
是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否
是否已取得基金从业资格	是
取得的其他相关从业资格	无
国籍	中国
学历、学位	硕士研究生
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是

3.离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	牛勇
离任原因	个人原因
离任日期	2018年1月15日
转任本公司其他工作岗位的说明	无
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

4其他需要说明的事项

本公司已将上述基金经理变更事项报中国证监会上海监管局备案。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2018年1月13日

华安沪深300量化增强型指数证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年1月13日

1 公告基本信息

基金名称	华安沪深300量化增强型指数证券投资基金
基金简称	华安沪深300增强
基金主代码	000312
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
离任基金经理姓名	牛勇
共同管理本基金的其他基金经理姓名	许之彦 孙晨进

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	牛勇
离任原因	个人原因
离任日期	2018年1月15日
转任本公司其他工作岗位的说明	无
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	是

3其他需要说明的事项

本公司已将上述基金经理变更事项报中国证监会上海监管局备案。

特此公告。

华安基金管理有限公司

2018年1月13日

证券代码:200152　证券简称:山航B　公告编号:2018-01

山东航空股份有限公司关于确认补贴收入的公告

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。

自2017年1月1日至2017年12月31日,山东航空股份有限公司(以下简称“公司”)收到中国民航局及各地区管理局、各级政府、机场等给予的支线补贴、节能减排基金、政府补贴、航线补贴等与收益相关的政府补助共计约1.02亿元,计入其他收益,预计增加公司2017年度净利润0.77亿元。

与资产相关的政府补助在在受益期内摊销,2017年度公司确认收入189.74万元, 计入其他收益,预计增加公司2017年度净利润142.31万元。

具体明细如下:

序号	补贴项目	确认金额	补贴单位	核算计入
1	节能减排	188,679.25	济南市高新技术产业开发区财政局	其他收益
2	支线补贴	10,200,000.00	中华人民共和国财政部	其他收益
3	其他政府补贴	9,238,779.08	中华人民共和国财政部、中国民用航空局等	其他收益
4	航线补贴	81,999,043.70	中华人民共和国财政部、济南市人民政府、各地机场等	其他收益
5	摊销递延收益	1,897,410.59		其他收益
	合计	103,523,912.62		

以上项目合计增加公司2017年度净利润约0.78亿元。

特此公告。

山东航空股份有限公司

董　事　会

二〇一八年一月十三日

证券代码:601777　证券简称:力帆股份　公告编号:临2018-008

力帆实业(集团)股份有限公司关于公司控股股东股份解质和质押的公告

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。

力帆实业(集团)股份有限公司(以下简称"公司")接到公司控股股东重庆力帆控股有限公司(以下简称"力帆控股")通知,力帆控股于2018年1月10日与国泰君安证券股份有限公司(以下简称"国泰君安")办理了股票质押式回购提前购回交易,解除了力帆控股所持公司原质押给国泰君安的股份45,300,000股,占公司总股本的3.47%。另外,力帆控股于2018年1月11日将所持的公司61,300,000股质押予国泰君安,期限不超过六个月,该次质押股份占公司总股本的4.69%,截止2018年1月12日,相关手续已办理完毕。

力帆控股质押上述公司股份是为满足其业务发展需要,目前力帆控股资信状况良好,具备履约能力,由此产生的质押风险在可控范围内,不存在平仓风险或被强制平仓的情形,不会导致公司实际控制权发生变更。

截至目前,力帆控股直接或间接持有的公司股份总数为636,778,922股,占公司总股本的比例为48.73%,均为无限售条件流通股份。此次股份解质及质押后,力帆控股质押股份数余额为579,436,401股,占其所持有公司股份总数的90.99%,占公司总股本比例为44.34%,均为无限售条件流通股。

特此公告。

力帆实业(集团)股份有限公司董事会

2018年1月13日

股票代码:601886　股票简称:江河集团　公告编号:临2018-002

江河创建集团股份有限公司第四届董事会第二十二次会议决议公告

本公司及董事会全体成员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、准确和完整承担个别及连带责任。

江河创建集团股份有限公司(以下简称 "公司")第四届董事会第二十二次会议于2018年1月12日在公司三楼会议室召开,会议应到董事9人,实到董事9人,符合《公司法》及《公司章程》规定。会议由公司董事长刘载望先生主持,经过讨论,一致通过如下决议:

通过《关于北京江河对新加坡江河增资的议案》

表决情况:9票同意,0票反对,0票弃权。

为了有效的规范公司业务架构,更好地满足公司经营发展需要,同意公司以全资子公司北京江河幕墙系统工程有限公司(简称"北京江河")对江河新加坡幕墙有限公司(简称"新加坡江河")增资500万新加坡元。增资完成后,新加坡江河的注册资本为650万新加坡元(约折合3175万人民币),公司持有其23.08%股权,北京江河持有其76.92%股权。

特此公告。

江河创建集团股份有限公司

董事会

2018年1月12日

股票代码:601886　股票简称:江河集团　公告编号:临2018-003

江河创建集团股份有限公司关于高级管理人员离职的公告

本公司及董事会全体成员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、准确和完整承担个别及连带责任。

江河创建集团股份有限公司(以下简称"公司")董事会近日接到公司副总经理熊宝先生的书面辞职报告,熊宝先生因个人原因向董事会请求辞去其担任的公司副总经理职务。

根据《公司法》、《公司章程》及有关法律法规的规定,熊宝先生的辞职报告自送达董事会之日起生效。熊宝先生离职后,将不在公司担任任何职务。公司对熊宝先生在任期间为公司做出的贡献表示衷心感谢。

特此公告。

江河创建集团股份有限公司

董事会

2018年1月12日

股票代码:002138　股票简称:顺络电子　编号:2018-006

深圳顺络电子股份有限公司关于第三大股东解除部分股权质押及重新质押的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳顺络电子股份有限公司(以下简称“公司”)于2018年1月12日接到公司第三大股东金倡投资有限公司(以下简称“金倡投资”)通知,获悉金倡投资所持有本公司的部分股份已办理解除质押及重新质押手续,具体事项如下:

一、股东股份解除质押的基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	解除质押股数(万股)	质押开始日期	解除质押日期	质权人	本次解除质押占其所持股份比例
金倡投资	否	450	2017年1月16日	2018年1月11日	深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司	9.43%

二、股东股份质押的基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数(万股)	质押开始日期(逐笔列示)	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
金倡投资	否	450	2018年1月11日	质权人办理解除质押登记之日	深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司	9.43%	借款

三、股东股份累计被质押的基本情况

截止本公告日,金倡投资持有公司股份数为47,719,980股,全部为无限售流通股,占公司目前总股本的5.84%,其中处于质押状态的股份累计数为42,200,000股,占其所持公司股份总数的88.43%,占公司总股本的5.17%。

四、备查文件

1.中国证券登记结算有限责任公司解除质押登记通知;

2.中国证券登记结算有限责任公司质押登记证明;

3.中国证券登记结算有限责任公司证券质押及司法冻结明细表;

4.深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司质押相关资料。

特此公告。

深圳顺络电子股份有限公司

董事会

二〇一八年一月十三日