华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）

（2019年第1号）

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司

二〇一九年一月

重要提示

华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金（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11月09日证监许可[2016]2607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12月1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。

本基金可投资于中小企业私募债券，其与一般信用债券相比，存在更大的信用风险和流动性风险。更大的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，信息披露不透明，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度；更大的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。这些特点使得中小企业私募债券可能出现因信用水平波动而引起的价格较大幅度波动，从而影响基金总体投资收益；同时，流动性差导致的变现困难，也会给基金总体投资组合带来流动性冲击。

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险。

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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2018年12月1日，有关财务数据截止日期为2018年9月30日，净值表现的截止日为2018年6月30日。

一、基金名称

本基金的名称：华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金。

二、基金的类型

本基金为混合型证券投资基金。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
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	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，上海金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，锦江国际（集团）有限公司计划财务部经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼金融事业部总经理，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）总公司副总裁，上海海立(集团)股份有限公司董事长，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、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理等职务。现任国泰君安证裕投资有限公司董事长、国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

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，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，硕士。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总经理助理兼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。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

（3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，19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，17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，硕士研究生学历，18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。

翁启森先生，硕士研究生学历，24年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾JP摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，14年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，19年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

2、本基金基金经理

石雨欣，硕士研究生，12年相关行业从业经验，曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008年1月加入华安基金管理有限公司，任固定收益部信用分析师。2015年7月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2015年7月至2017年6月担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2016年2月起担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年8月起同时担任华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016年12月起，同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、本基金的基金经理。2017年1月起，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年2月起，同时担任华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

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，副总经理、首席投资官

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，指数与量化投资部高级总监、总经理助理

贺涛先生，固定收益部总监

苏昕涵先生，全球投资部副总监

万建军先生，投资研究部联席总监

谢振东先生，基金投资部副总监

崔莹先生，基金投资部助理总监

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2018年12月31日，公司目前共有员工358人（不含香港公司），其中57%具有硕士及以上学位，92%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

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987年4月20日

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：保险兼业代理业务（有效期至2020年09月09日）；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年，中信银行成功收购中国国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过三十年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年，中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

二、主要人员情况

孙德顺先生，中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行（国际）董事长。此前，孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长；2014年3月起任本行执行董事；2011年12月至2014年5月任本行副行长，2011年10月起任本行党委副书记；2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长；2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长；1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心（北京）等单位工作，期间，1995年12月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长，1999年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心（北京）总经理；1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学，获经济学硕士学位。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。杨先生自2015年7月起任本行党委委员，2015年12月起任本行副行长。此前，杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长；2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长；1982年8月至2006年6月在中国建设银行河南省分行工作，历任计财处副处长，信阳分行副行长、党委委员，计财处处长，郑州市铁道分行党委书记、行长，郑州分行党委书记、行长，河南省分行党委副书记、副行长（主持工作）。杨先生为高级经济师，研究生学历，管理学博士。

杨洪先生，现任中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历，高级经济师，教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行，相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长，总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长，总行行政管理部总经理。

三、基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2018年6月末，中信银行已托管154只公开募集证券投资基金，以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到8.56万亿元人民币。

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）38969973

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号英监国际金融中心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：赵安平

（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

（1）中信银行股份有限公司

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

电话：4006800000

传真：010-85230056

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（2）其他基金代销机构详见基金份额发售公告。

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：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：毛鞍宁

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

经办注册会计师：蒋燕华、蔡玉芝

联系人：蒋燕华

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货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)。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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：股票占基金资产的比例为0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。

（二）股票投资策略

本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将积极主动的投资风格与严谨规范的选股方法相结合，综合运用“自上而下”和“自下而上”的投资方法进行行业配置和个股选择；在对宏观经济运行、行业景气变化以及上市公司成长潜力进行定量评估、定性分析和实地调研的基础上，优选重点行业中基本面状况健康、具有估值优势、成长性良好、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。

（三）债券投资策略

（1）资产配置策略

本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等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，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。

（2）利率类品种投资策略

本基金对国债等利率品种的投资，是在对国内外宏观经济运行状况及政策环境等进行分析和预测基础上，研究利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化趋势，深入分析利率品种的收益和风险，预测调整债券组合的平均久期，并通过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。

（3）信用债投资策略

本基金将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、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，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

（4）可转债投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券的债性和股性，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，并最终选择合适的投资品种。

（5）中小企业私募债投资策略

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。

（四）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。

（五）权证投资策略

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，充分考量可授权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

（六）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证800指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

中证800指数是由中证指数有限公司编制，该指数编制合理、透明，市场覆盖率较广、不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中债综合全价指数收益率是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

本基金是混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或上述业绩比较基准指数停止编制或更改名称，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，无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

（下转B19版）

华安基金管理有限公司
关于华安年红定期开放债券型证券投资基金分红公告

公告送出日期：2019年1月15日

1.公告基本信息

基金名称	华安年年红定期开放债券型证券投资基金		
基金简称	华安年年红债券		
基金主代码	000227		
基金合同生效日	2013年11月14日		
基金管理人名称	华安基金管理有限公司		
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司		
公告依据	根据《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和《华安年年红定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定		
收益分配基准日	2018年12月31日		
有关年度分红次数的说明	本次分红为2018年度的第四次分红		
注：《华安年年红定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定：“在符合有关基金分红条件的前提下，每季度末基金份额可供分配利润超过0.01元时，本基金至少进行收益分配1次，本基金每年收益分配次数最多为12次；每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的50%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。”			
下属分级基金的基金简称	华安年年红债券A	华安年年红债券C	
下属分级基金的交易代码	000227	001994	
截止基准日下属分级基金的相关指标	基准日下属分级基金份额净值（单位：元）	1.068	1.065
	基准日下属分级基金可供分配利润（单位：元）	5,246,518.2	1,280,301.08
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：元）	2,623,259.1	640,150.54
本次下属分级基金分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.160	0.150

2.与分红相关的其他信息

权益登记日	2019年1月17日
除息日	2019年1月17日
现金红利发放日	2019年1月18日
分红对象	权益登记日在华安基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人
红利再投资相关事项的说明	1)红利再投资日：2019年1月18日； 2)选择红利再投资方式的投资者所转换的基金份额将于2019年1月21日直接计入其基金账户，1月22日起可查询； 3)红利再投资按红利划出日（2019年1月18日）的基金份额净值转换基金份额，不足0.01份基金份额的，四舍五入； 4)权益登记日之前（截至2019年1月17日）被冻结或托管转出尚未转入的基金份额应分得的现金红利按红利再投资方式处理。
税收相关事项的说明	根据相关法律法规的规定，对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次分红免收分红手续费和再投资手续费。

3.其他需要提示的事项

1）基金份额持有人可以选择现金红利或将所获红利再投资于本基金，如果基金份额持有人未选择本基金具体分红方式，则默认为现金方式。

2）投资者可以在每个基金开放日的交易时间内到销售网点查询和修改分红方式，也可以通过华安基金管理公司网站或电话交易系统查询和变更基金收益分配方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，将按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准。

凡希望修改分红方式的，请务必在2019年1月16日之前（含该日）办理变更手续。

3）如有其它疑问，请拨打本公司客户服务电话(40088-50099)或登陆本公司网站(www.huaan.com.cn)获取相关信息。

特此公告

华安基金管理有限公司
2019年1月15日

华安基金管理有限公司
关于华安年盈定期开放债券型证券投资基金分红公告

公告送出日期：2019年1月15日

1.公告基本信息

基金名称	华安年年盈定期开放债券型证券投资基金		
基金简称	华安年年盈定期开放债券		
基金主代码	000239		
基金合同生效日	2015年2月3日		
基金管理人名称	华安基金管理有限公司		
基金托管人名称	中国银行股份有限公司		
公告依据	根据《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定		
收益分配基准日	2018年12月31日		
有关年度分红次数的说明	本次分红为2018年度的第二次分红		
注：《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定：“在符合有关基金分红条件的前提下，每季度末基金份额可供分配利润超过0.01元时，本基金至少进行收益分配1次，本基金每年收益分配次数最多为12次；每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的50%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。”			
下属分级基金的基金简称	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C	
下属分级基金的交易代码	000239	000240	
截止基准日下属分级基金的相关指标	基准日下属分级基金份额净值（单位：元）	1.028	1.023
	基准日下属分级基金可供分配利润（单位：元）	1,599,530.91	153,674.27
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额（单位：元）	799,765.46	76,837.14
本次下属分级基金分红方案（单位：元/10份基金份额）		0.124	0.098

2.与分红相关的其他信息

权益登记日	2019年1月17日
除息日	2019年1月17日
现金红利发放日	2019年1月18日
分红对象	权益登记日在华安基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人
红利再投资相关事项的说明	1)红利再投资日：2019年1月18日； 2)选择红利再投资方式的投资者所转换的基金份额将于2019年1月21日直接计入其基金账户，1月22日起可查询； 3)红利再投资按红利划出日（2019年1月18日）的基金份额净值转换基金份额，不足0.01份基金份额的，四舍五入； 4)权益登记日之前（截至2019年1月17日）被冻结或托管转出尚未转入的基金份额应分得的现金红利按红利再投资方式处理。
税收相关事项的说明	根据相关法律法规的规定，对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次分红免收分红手续费和再投资手续费。

3.其他需要提示的事项

1）基金份额持有人可以选择现金红利或将所获红利再投资于本基金，如果基金份额持有人未选择本基金具体分红方式，则默认为现金方式。

2）投资者可以在每个基金开放日的交易时间内到销售网点查询和修改分红方式，也可以通过华安基金管理公司网站或电话交易系统查询和变更基金收益分配方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，将按照投资者在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准。

凡希望修改分红方式的，请务必在2019年1月16日之前（含该日）办理变更手续。

3）如有其它疑问，请拨打本公司客户服务电话(40088-50099)或登陆本公司网站(www.huaan.com.cn)获取相关信息。

特此公告

华安基金管理有限公司
2019年1月15日

华安基金管理有限公司
关于调整华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购清单的提示性公告

根据华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2018年12月3日发布的《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》、《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》、2019年1月8日发布的《关于华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金延长募集期的公告》，华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”，认购代码：512273）自2018年12月6日至2019年2月28日公开发售，投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金，其中，网上现金认购的日期为2019年2月26日至2019年2月28日；通过基金管理人和发售代理机构进行网下现金认购和网下股票认购的日期为2018年12月6日至2019年2月28日。

根据中证指数有限公司关于调整沪深300行业中性低波动样本股的相关通知，本公司将根据本基金基金合同及招募说明书的有关规定，自2019年1月15日起相应调整本基金网下股票认购清单如下：

代码	名称	代码	名称	代码	名称
000157	中联重科	600028	中国石化	600977	中国电影
000166	申万宏源	600050	中国联通	600998	九州通
000402	金融街	600066	宇通客车	601006	大秦铁路
000413	东旭光电	600085	同仁堂	601009	南京银行
000423	东阿阿胶	600089	特变电工	601018	宁波港
000538	云南白药	600100	同方股份	601166	兴业银行
000625	长安汽车	600104	上汽集团	601169	北京银行
000630	铜陵有色	600111	北方稀土	601211	国泰君安
000709	河钢股份	600153	建发股份	601216	君正集团
000725	京东方A	600170	上海建工	601229	上海银行
000776	广发证券	600177	雅戈尔	601238	广汽集团
000783	长江证券	600219	南山铝业	601288	农业银行
000876	新希望	600362