（上接B30版）

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制将资产配置于稳健资产与风险资产。本基金投资的稳健资产为国内依法发行交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、商业银行金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产；本基金投资的风险资产为国内依法发行上市的股票、权证、股指期货等权益类资产。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对稳健资产和风险资产的投资比例进行动态调整。本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%；债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金采用基于VaR的风险乘数全程可变的CPPI策略（恒定比例组合保险策略）。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整稳健资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。同时，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，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，确定具体的投资券种选择，积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。

（一）稳健资产和风险资产的配置策略

按照恒定比例组合保险原理，本基金将根据市场的波动、组合安全垫的大小确定并动态调整稳健资产与风险资产的投资比例，通过对稳健资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对风险资产的投资寻求保本期间资产的稳定增值。本基金对稳健资产和风险资产的资产配置具体可分为以下三步：

第一步，确定基金价值底线和安全垫。根据保本周期末投资组合最低目标价值（即最低保本金额，本基金的最低保本金额为投资本金的100%）和合理的折现率，计算当期的最低保本金额现值（即基金价值底线），基金资产净值超过基金价值底线的数额即为安全垫；

第二步，确定风险资产和稳健资产配置比例。根据风险资产的预期风险收益特性和我司相关量化模型确定当期风险乘数上限，在此基础上结合市场判断和安全垫厚度等因素设定当期风险乘数，据此将放大后的安全垫投资于风险资产，其余金额则配置于稳健资产；

第三步，调整风险乘数及资产配置比例。在保本周期内，定期计算风险乘数上限并对实际风险乘数（风险资产/安全垫）进行监控，一旦实际风险乘数超过当期风险乘数上限，则重复前两个步骤的操作，对风险乘数进而整体资产配置比例进行动态调整。

CPPI策略举例说明：

假定基金合同生效日本基金资产净值为50亿元，当期三年期无风险利率为3%（年利率，按复利计算）。

[illegible]

（二）稳健资产投资策略

本基金将通过大类资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次自上而下进行稳健资产的投资管理，力求在实现保本目标的基础上适当捕捉稳定收益机会。

大类资产配置主要是通过对宏观经济趋势、货币金融政策和利率走势的判断确定稳健资产在利率类、信用类和货币类资产之间的配置比例，同时也对银行间市场和交易所市场进行选择性配置。

类属资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用环境等进行具体券种的配置。除了国债、金融债、央票、短融、中票、企业债、公司债、债券回购等类型外，本基金还将在综合考虑风险和收益的基础上审慎进行可转债、资产支持证券等品种的投资。

1.可转债投资策略

可转债同时具有债券、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债的内在债券价值（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。

2.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、个券选择和市场交易机会捕捉等积极策略，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。

个券选择方面，本基金将首先根据保本周期尽可能地投资于剩余期限匹配的固定收益工具并持有到期，以最大限度控制组合利率风险和流动性风险、实现本金保障；其次，本基金还将通过利率趋势分析、投资人偏好分析、收益率曲线形态分析、信用分析和流动性分析等，筛选出流动性良好、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

（三）风险资产投资策略

1. 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。

2.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。

3.股票指数期货投资策略

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），并根据风险资产投资（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，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

九、基金的业绩比较基准

（一）衡量基金整体业绩的比较基准

本基金整体业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）

上述“三年期银行定期存款收益率”是指中国人民银行网站上发布的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。基金存续期内，三年期银行定期存款收益率随中国人民银行公布的利率水平的调整而调整。

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，而无需召开基金份额持有人大会。

（二）比较基准选择理由

本基金选择三年期银行定期存款收益率作为业绩比较基准主要考虑如下：

1.本基金是保本基金，通过第三方担保机制的引入和投资组合保险技术的运用实现基金资产的保值增值目标，其主要目标客户为低风险偏好的定期存款客户，以三年期定期存款利率作为业绩比较基准，符合本基金的产品定位和风险收益特征。

2.本基金保本周期为30个月，通过保本周期内高赎回费率的设置和随持有期限递减的赎回费率结构安排，鼓励长期持有、稳健投资。以三年期银行定期存款收益率作为业绩比较基准与目标客户群的预期持有期限基本一致。

3.三年期银行定期存款收益率容易被广大投资人所理解和接受。

综上所述，选择三年期定期存款利率作为本基金的业绩比较基准，能比较贴切地体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

十、风险收益特征

本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月18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。

10.1 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	28,445,149.73	0.58
	其中：股票	28,445,149.73	0.58
2	固定收益投资	4,429,579,309.70	90.56
	其中：债券	4,429,579,309.70	90.56
	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	349,700,694.55	7.15
	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	44,648,293.13	0.91
7	其他各项资产	39,174,937.85	0.80
8	合计	4,891,548,384.96	100.00

10.2 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	13,616,676.52	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,599,786.58	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,192,452.15	0.11
J	金融业	-	-
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	28,445,149.73	0.58

10.3 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	600548	深高速	551,100	4,893,768.00	0.10
2	600498	烽火通信	181,100	4,556,476.00	0.09
3	000800	一汽轿车	260,386	3,668,838.74	0.08
4	600476	湘邮科技	81,100	2,954,473.00	0.06
5	000404	华意压缩	294,700	2,487,268.00	0.05
6	002357	富临运业	174,300	2,431,485.00	0.05
7	601021	春秋航空	48,999	2,274,533.58	0.05
8	300017	网宿科技	38,315	2,237,979.15	0.05
9	300196	长海股份	62,454	2,020,386.90	0.04
10	002035	华帝股份	23,110	410,664.70	0.01

10.4 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	235,282,000.00	4.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	383,275,000.00	7.85
	其中：政策性金融债	383,275,000.00	7.85
4	企业债券	106,068,000.00	2.17
5	企业短期融资券	3,586,434,000.00	73.48
6	中期票据	99,423,000.00	2.04
7	可转债	19,097,309.70	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,429,579,309.70	90.76

10.5 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	3,500,000	363,265,000.00	7.44
2	019515	15国债15	2,350,000	235,282,000.00	4.82
3	011699126	16恒健SCP001	1,000,000	100,200,000.00	2.05
4	071602001	16国泰君安CP001	1,000,000	100,080,000.00	2.05
5	011699115	16东航集SCP001	1,000,000	100,040,000.00	2.05

10.6 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。

10.7 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。

10.8 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。

10.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.9.1 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。

10.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

10.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.10.1 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。

10.10.2 本期国债期货投资评价

无。

10.11 投资组合报告附注

10.11.1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。

10.11.2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。

10.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	420,076.12
2	应收证券清算款	1,504,261.48
3	应收股利	-
4	应收利息	37,249,110.32
5	应收申购款	1,489.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,174,937.85

10.11.4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。

10.11.5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）

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2015年11月16日（合同生效日）起至2015年12月31日止	0.50%	0.07%	0.35%	0.01%	0.15%	0.06%

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、保本周期内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1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.2%÷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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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。

在保本周期内，本基金的保证费用或风险买断费用从基金管理人的管理费收入中列支。

2、保本周期内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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

3、本基金在到期操作期间（除保本周期到期日）和过渡期内，基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

4、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，变更为“华安安益灵活配置混合型证券投资基金”后，基金管理费、基金托管费自变更为“华安安益灵活配置混合型证券投资基金”的当日按下述标准开始计提：

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

5、除基金管理费和基金托管费之外的基金费用，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。

6、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的5个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

（二）与基金销售有关的费用

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、登记等各项费用。

（1）保本周期内的申购费用

保本周期内，本基金的申购费用在投资者申购基金份额时收取。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。

通过直销机构申购本基金基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

其他投资人的申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在保本周期内如果有多笔申购，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	1.3%
100万≤M<300万	0.8%
300万≤M<500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

（2）过渡期内的申购费用

保本周期到期后，若符合保本基金存续条件（详见本招募说明书第九章），本基金转入下一保本周期，并在下一保本周期开始前安排过渡期进行申购。过渡期申购费率及收费方式在届时的临时公告或更新的基金招募说明书中列示。

（3）转型为“华安安益灵活配置混合型证券投资基金”后的申购费用

保本周期到期后，若不符合保本基金存续条件，本基金将转型为“华安安益灵活配置混合型证券投资基金”。转型后的申购费率及收费方式以届时公告为准。 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。

（1）保本周期和到期操作期间内的赎回费用

保本周期和到期操作期间内，本基金赎回费率随申请份额持有时间的增加而递减，持有期从投资人获得基金份额开始计算。具体费率如下表所示：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<1.5年	1.5%
1.5年≤N<2.5年	1.0%
N≥2.5年	0

其中，1.5年为18个月，2.5年为30个月，以此类推。

对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

在到期操作期间内，对于适用保本条款的基金份额无需支付赎回费用。

（2）转型为“华安安益灵活配置混合型证券投资基金”后的赎回费用

保本周期到期后，若本基金转型为“华安安益灵活配置混合型证券投资基金”，转型后的赎回费率以届时公告为准。

3、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整本基金的申购、赎回费率或收费方式，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。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定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。3. 基金份额的转换

本基金转换费用包括基金转换申购补差费和转出基金赎回费两部分。

（1）基金转换申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费低于转入基金的申购费的，补差费为转入基金的申购费和转出基金的申购费差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费高于转入基金的申购费的，补差费为零。

（2）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。基金转换费用由基金份额持有人承担。转换的目标基金所适用的申购与赎回费率详见各基金最新的招募说明书。

具体公式如下：

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：

如果，转入基金的申购费＞转出基金的申购费，

基金转换申购补差费＝转入基金的申购费－转出基金的申购费

如果，转出基金的申购费≥转入基金的申购费，

基金转换申购补差费＝ 0

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，转入基金固定申购费金额

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，转出基金固定申购费金额

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，由此产生的误差计入基金资产。

（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、期货交易费用；

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

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）基金管理费和基金托管费的调整

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介上刊登公告。

（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

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
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。
五、相关服务机构	更新了销售机构的相关信息；
六、基金的募集	更新了基金募集的相关信息。
七、基金合同的生效	更新了基金合同生效的相关信息。
八、基金份额的申购、赎回与转换	调整了单笔最低赎回份额、单笔最低转换转出份额和单个交易账户持有份额的最低保留余额。
十一、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
十二、基金的业绩	更新了本基金自成立以来的历史业绩。
二十三、对基金投资人的服务	更新了开通基金电子直销交易资金结算的第三方支付渠道，详见招募说明书。
二十四、其他应披露事项	增加本部分，披露了自2015年11月16日至2016年5月16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

二〇一六年六月三十日

证券代码：002353 证券简称：杰瑞股份 公告编号：2016-048

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司关于发起设立金融租赁公司的公告

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。

重要内容提示：

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司（以下简称“公司”或“杰瑞股份”）拟与恒丰银行股份有限公司（以下简称“恒丰银行”）、君康人寿保险股份有限公司（以下简称“君康人寿”）、山东南山铝业股份有限公司（以下简称“南山铝业”）共同出资设立“恒丰金融租赁有限公司”（以下简称“恒丰租赁”，暂定名，最终以国家相关部门审批及核准的名称为准）。公司以现金方式出资人民币10,000万元，占恒丰租赁注册资本的10%。

特别风险提示：

恒丰金融租赁有限公司尚需经中国银行业监督管理委员会(以下简称“中国银监会”)批准筹建，筹建完成后仍需经其派出机构核准后方可开业。

一、对外投资概述

1、公司拟与恒丰银行、君康人寿、南山铝业共同投资设立“恒丰金融租赁有限公司”（暂定名，最终以国家相关部门审批及核准的名称为准）。恒丰租赁拟定注册资本人民币100,000万元，其中公司拟以自有资金现金出资10,000万元，占注册资本的10%；恒丰银行出资60,000万元，占注册资本的60%；君康人寿出资20,000万元，占注册资本的20%；南山铝业出资10,000万元，占注册资本的10%。公司有权提名一名董事与一名监事参与恒丰租赁的管理。

2、本事项已经2016年6月29日公司第三届董事会第二十七次会议审议通过。本事项在公司董事会审批权限内，无需提交公司股东大会审议批准。

3、本次对外投资不涉及关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

二、交易对手方介绍

(一)恒丰银行股份有限公司

1、公司名称：恒丰银行股份有限公司

2、类型：股份有限公司

3、法定代表人：蔡国华

4、注册资本：169,000万元人民币

5、成立日期：1987年11月23日

6、住所：山东省烟台市芝罘区南大街248号

7、经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务。(有效期限以许可证为准)。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)。

8、股权结构：恒丰银行的控股股东为烟台蓝天投资控股有限公司。

(二)君康人寿保险股份有限公司

1、公司名称：君康人寿保险股份有限公司

2、类型：其他股份有限公司(非上市)

3、法定代表人：郑永刚

4、注册资本：380,000 万元人民币

5、成立日期：2006年11月06日

6、住所：北京市顺义区华英园9号

7、经营范围：人寿保险、健康保险、意外伤害保险等各类人身保险业务；上述业务的再保险业务；国家法律、法规允许的保险资金运用业务；经中国保监会批准的其他业务。（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。）

8、股权结构：君康人寿的控股股东为宁波市鄞州鸿发实业有限公司。

(三)山东南山铝业股份有限公司

1、公司名称：山东南山铝业股份有限公司

2、类型：股份有限公司

3、法定代表人：宋昌明

4、注册资本：283,518.4361万元人民币

5、成立日期：1993年03月18日

6、住所：龙口市东江镇前宋村

7、经营范围：许可证范围内电力生产(有效期限以许可证为准)；天然气销售(限分支机构经营)；锻造产品、石墨和碳素制品、铝及铝合金制品开发、生产、加工、销售；批准范围的自营进出口、进料加工和“三来一补”业务；装饰装修及铝合金结构制品、铝门窗的安装（须凭资质证书经营）；模具设计与制造；燃气灶具、金属材料、机械设备销售；铝合金压力加工工程和技术研究开发、技术咨询、技术服务；检验测试。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)。

8、股权结构：南山铝业的控股股东为南山集团有限公司。

截至本公告日，恒丰银行、君康人寿、南山铝业及其公司股东、高管与本公司及持有本公司百分之五以上股份的股东、实际控制人之间不存在关联关系。

三、投资标的基本情况

（一）出资方式：以自有资金现金出资

（二）恒丰金融租赁有限公司基本情况

1、拟成立公司名称：恒丰金融租赁有限公司

2、拟注册地：深圳市前海港合作区湾一路63号前海企业公馆22栋B单元。

3、拟注册资本：100,000万元人民币

4、拟经营范围：融资租赁业务；转让和受让融资租赁资产；固定收益类证券投资业务；接受承租人的租赁保证金；吸收非银行股东3个月（含）以上定期存款；同业拆借；向金融机构借款；境外借款；租赁物变卖及处理业务；经济咨询；中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。

5、恒丰租赁股权结构如下：

序号	股东名称	出资额（万元）	出资比例
1	恒丰银行股份有限公司	60,000.00	60.00%
2	君康人寿保险股份有限公司	20,000.00	20.00%
3	烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司	10,000.00	10.00%
4	山东南山铝业股份有限公司	10,000.00	10.00%
合计		100,000.00	100.00%

四、协议主要内容

公司于2016年6月29日签署了《恒丰金融租赁有限公司发起人协议》（以下简称“发起人协议”）。主要内容如下：

甲方：恒丰银行股份有限公司

乙方：君康人寿保险股份有限公司

丙方：烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司

丁方：山东南山铝业股份有限公司

第七条 本公司的注册资本为人民币10亿元整，各发起人全部以现金出资，其中：

甲方：出资额为6亿元，以现金出资，占注册资本的60%；

乙方：出资额为2亿元，以现金出资，占注册资本的20%；

丙方：出资额为1亿元，以现金出资，占注册资本的10%；

丁方：出资额为1亿元，以现金出资，占注册资本的10%。

第九条 发起人的义务

（一）全权委托甲方作为申请人，代表全体发起人办理本公司筹建、开业申请事宜；

（二）协议各方应当在规定的期限内足额缴纳各自所认缴的出资额；

（三）协议各方以其出资额为限对新设公司承担责任。协议各方在新设公司登记后，不得抽回出资；

（四）新设公司发给协议各方的出资证明书不得私自交易和质押，仅作为公司内部分红的依据；

（五）协议各方如违反本协议，不按规定缴纳出资，应向已足额缴纳出资的出资人承担违约责任，违约方按其应出资额的1%向已足额缴纳出资的出资人支付违约金。协议各方不按规定缴纳出资导致公司不能成立的，按其应出资额的5%向其他出资人支付违约金；

（六）协议各方在新设公司设立过程中，故意或过失侵害公司利益的，应向公司或其他出资人承担赔偿责任；

（七）法律、行政法规规定应当承担的其他义务。

第十条 申请设立本公司的费用由甲方先行垫付，在本公司设立成功后，将全部费用列入本公司的开办费用。申请设立本公司的费用，包括但不限于：

（一）装修设计与施工费、筹建工作组办公费、注册登记费、业务招待费、律师费、宣传费、交通费、会议费、差旅费、印刷费；

（二）其他申请设立、筹建、开业期间的各项费用。

第十一条 在本公司不能成立时，同意对设立行为所产生的债务和费用支出按各发起人的出资比例进行分摊。

第十三条 发起人各方投入本公司的资金，均为自有资金，非他人委托资金或债务资金等非自有资金。

第十四条 发起人各方承诺在本公司成立后，不与其发生违规关联交易。

第十五条 发起人各方承诺5年内不转让所持有的本公司公司股权，但银监会依法责令转让的除外。

第十六条 发起人各方承诺不将所持有的本公司股权进行质押或设立信托。

第二十条 履行本协议过程中，发起人各方如发生争议，应尽可能通过协商途径解决；如协商不成，任何一方均可向甲方所在地的人民法院起诉，级别管辖遵守法律的相关规定。

五、对外投资的目的、存在的风险和对公司的影响

1、对外投资的目的及对公司的影响

（1）有利于促进公司产品线与新兴金融工具的结合，扩大公司现有产品线的营销力度，丰富营销手段，为客户提供更具附加值的服务。

（2）通过金融租赁平台，可以整合公司自身业务优势及客户资源，加快对销售环节融资租赁需求的响应速度，增强公司的竞争实力，达到促进销售的目的，推动公司业务更快发展。

（3）将显著加快资金回笼速度，尤其是重大订单的回款，改善公司的现金流质量。

（4）能够借助金融机构的风险评估工具和管控措施，降低客户违约风险。

2、存在的风险及对策

（1）恒丰租赁需经中国银监会批准筹建并经其派出机构核准方可开业。

（2）恒丰租赁运行受市场利率、汇率等外部宏观经济环境以及内部管理等多种因素变动影响，恒丰租赁未来的经营业绩对公司的投资回报有一定的不确定性。

（3）恒丰租赁的主要发起人恒丰银行股份有限公司作为全国性股份制商业银行，在金融业务管理和风险管理等方面拥有丰富的经验，有利于恒丰租赁的经营和管理；同时公司未来将充分行使股东权利，对恒丰租赁的业务发展、风险防范等经营管理工作提出意见和建议，并采取有效手段对其经营情况进行监督。

六、其他

由于恒丰租赁正处于筹备组建阶段，尚需经中国银监会批准筹建并经其派出机构核准开业，在材料申报、审批乃至最终批准/核准的过程中仍可能进行调整，因此存在不确定性。敬请广大投资者注意投资风险，谨慎投资。

公司将按照有关规定，根据该事项进展情况，及时履行信息披露义务。

特此公告。

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司董事会

2016年6月29日

证券代码：002353 证券简称：杰瑞股份 公告编号：2016-047

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司第三届董事会第二十七次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披