

华安生态优先股票型证券投资基金  
更新的招募说明书摘要  
(2015 年第 1 号)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一五年一月

## 重要提示

华安生态优先股票型证券投资基金（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2013年7月30日证监许可[2013]1017号文核准。本基金的基金合同自2013年11月28日正式生效。

本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的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购基金时应当认真阅读《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、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。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投资风险，由投资者自行承担。

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，本招募说明书摘要所载内容截止日为2014年11月28日，有关财务数据截止日为2014年9月30日，净值表现截止日为2014年6月30日。

## 目 录

一、基金管理人.....	1
二、基金托管人.....	6
三、相关服务机构.....	10
四、基金的名称.....	18
五、基金的类型.....	18
六、基金的投资目标.....	18
七、基金的投资方向.....	18
八、基金的投资策略.....	19
九、基金的业绩比较基准.....	25
十、基金的风险收益特征.....	26
十一、基金投资组合报告.....	26
十二、基金的业绩.....	31
十三、费用概览.....	31
十四、对招募说明书更新部分的说明.....	35

## 一、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：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层
- 3、办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期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%
上海电气（集团）总公司	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，大专学历。历任上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、

副总经理并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董事长、法定代表人，党总支书记，同时代行公司总经理职务。

冯祖新先生，研究生学历。历任上海市经济委员会信息中心副主任、主任，上海市工业投资公司副总经理、总经理，上海工业投资（集团）有限公司副总裁、党委副书记。现任上海工业投资（集团）有限公司执行董事（法定代表人）、总裁、党委书记。

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副董事长、长江养老保险股份有限公司董事、史带财产保险股份有限公司董事、上海国际信托有限公司监事。

董鑑华先生，大学学历，高级经济师。历任上海市审计局固定资产投资科员、副处长、处长，上海市审计局财政审计处处长，现任上海电气（集团）总公司财务总监。

王松先生，研究生学历，高级经济师。历任建设银行总行投资部职员，国泰证券有限公司北京办事处副主任、发行二部副总经理、债券部总经理，国泰君安证券股份有限公司债券业务一部总经理、固定收益证券总部总经理、固定收益证券总部总监、总裁助理，现任国泰君安证券股份有限公司副总裁。

#### 独立董事：

萧灼基先生，研究生学历，教授。历任全国政协委员，政协经济委员会委员，北京大学经济学院教授，博士生导师，北京市、云南省、吉林省、成都市、武汉市等省市专家顾问，北京市场经济研究所所长，《经济界》杂志社社长、主编。

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、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

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。历任上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局机构监管一处处长、上市公司监管一处处长，长城证券有限责任公司副总经理、党委委员、纪委书记、合规总监，现任国泰君安证券总裁助理、投行业务委员会副总裁、华安基金管理有限公司监事会主席。

陈涵女士，研究生学历，经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部副科长、科长，现任上海国际信托有限公司投资管理总部高级经理。

柳振铎，硕士研究生，高级经济师。历任上海良工阀门厂副厂长，上海机电工业管理局规划处处长，上海电机（集团）有限公司总经理，上海电气（集团）总公司副总裁，兼：上海电气资产管理有限公司总裁、上海机电股份有限公司党委书记、总经理，上海集优机械股份有限公司董事长，上海工业锅炉研究所所长。现任中国电器工业协会工业锅炉分会五届理事会理事长。

章卫进先生，大专学历，会计师。历任上海市有色金属总公司财务处科员、外经处会计主管，英国 SONOFEC 公司（长驻伦敦）业务经理，上海有色金属总公司房产公司财务部经理、办公室主任，上海工业投资（集团）有限公司财务部业务主管、副经理，现任上海工业投资（集团）有限公司财务部经理。

李梅清女士，大专学历，会计师。历任上海新亚（集团）股份有限公司财务部副经理、上海新亚（集团）有限公司财务部副经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部副经理及上市公司部副经理，上海锦江国际投资管理有限公司财务总监、金融事业部财务总监。

汪宝山先生，大学学历，经济师。历任建行上海市分行团委书记、直属党委书记，建行宝山宝钢支行副行长，建行上海市分行办公室副主任，国泰证券公司综合管理部总经理，公司专职党委副书记兼行政管理部总经理，公司专职党委副书记兼上海营业总部总经理，国泰君安证券专职董事、党委办公室主任、机关党委书记，公司党委委员、工会主席，国泰君安投资管理股份有限公司董事长、党委书记、国泰君安证券股份有限公司党委委员。

赵敏先生，研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任

华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理。

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，大专学历。历任上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理并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董事长、法定代表人，同时代行公司总经理职务。

尚志民先生，研究生学历，17年证券、基金从业经验。曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，1999年6月至2001年9月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000年7月至2001年9月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003年9月至今担任安顺证券投资基金的基金经理，2006年9月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。现任华安基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。

秦军先生，研究生学历，15年证券、基金从业经验，曾任中国航空工业规划设计研究院建设监理部总经理助理，中合资产管理有限责任公司北京分公司总经理，嘉实基金管理有限公司总经理助理，现任华安基金管理有限公司副总经理。

章国富先生，研究生学历，26年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹（集团）有限公司财务部副部长（主持工作）、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监、华安基金管理有限公司督察长，现任华安基金管理有限公司副总经理。

童威先生，博士研究生学历，13年证券、基金从业经验。曾任上海证券有限责任公司研究发展中心部门总经理，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，自2014年12月起任华安基金管理有限公司副总经理。

薛珍女士，研究生学历，13 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信息调研处处长，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

施卫平先生，金融硕士研究生，20 年证券、基金行业从业经验，具有证券从业资格。曾任浙江金达期货经纪有限公司研究员、浙江中大集团投资经理、东方证券股份有限公司研究员、国联安基金管理有限公司基金经理。2014 年 1 月加入华安基金管理有限公司。2014 年 4 月起同时担任本基金及华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：

李冠宇先生，自 2013 年 11 月 28 日至 2014 年 12 月 30 日担任华安生态优先股票型证券投资基金的基金经理。

3、本公司采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

朱学华先生，董事长、党总支书记、代行公司总经理职务

尚志民先生，副总经理、首席投资官

翁启森先生，基金投资部兼全球投资部高级总监、基金经理

杨 明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，指数投资部高级总监

贺 涛先生，固定收益部副总监、基金经理

陈俏宇女士，基金投资部副总监、基金经理

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 2014 年 12 月 31 日，公司目前共有员工 291 人，主要来自国内外证券公司等金融机构，其中 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。



## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

2014 年上半年，本集团实现利润总额 1,695.16 亿元，较上年同期增长 9.23%；净利润 1,309.70 亿元，较上年同期增长 9.17%。营业收入 2,870.97 亿元，较上年同期增长 14.20%；其中，利息净收入增长 12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长 8.39%，在营业收入中的占比达 20.96%。成本收入比

24.17%，同比下降 0.45 个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为 13.89%和 11.21%，同业领先。

截至2014年6月末，本集团资产总额163,997.90亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户贷款和垫款总额91,906.01亿元，增长6.99%；负债总额152,527.78亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户存款总额129,569.56亿元，增长6.00%。

截至2014年6月末，中国建设银行公司机构客户326.89万户，较上年末增加20.35万户，增长6.64%；个人客户近3亿户，较上年末增加921万户，增长3.17%；网上银行客户1.67亿户，较上年末增长9.23%，手机银行客户数1.31亿户，增长12.56%。

截至2014年6月末，中国建设银行境内营业机构总量14,707个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备72,128台，较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%，较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工240余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理

及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2014 年 9 月末，中国建设银行已托管 389 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监

督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金销售机构

##### 1、直销机构

(1) 华安基金管理有限公司上海业务部

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 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：朱江

(3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区华夏路 10 号富力中心 1203 室

电话：(020) 38199200

传真：(020) 38927962

联系人：张彤

(4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街 88 号长安国际中心 A 座 706 室

电话：(029) 87651811

传真：(029) 87651820

联系人：史小光

(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：张彤

(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](http://www.huaan.com.cn)

华安电子交易热线：40088-50099

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

传真电话：(021) 33626962

联系人：谢伯恩

## 2、代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 交通银行股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：牛锡明

电话：(021) 58766688

传真：(021) 58798398

联系人：曹榕

客服电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(3) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：(86) 10-66596688

传真：(86) 10-66594568

客户服务电话：95566

网址： [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(4)中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

传真：010-66107571

客户服务电话：95588

网址： [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(5)中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址： [www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(6)招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195109

客户服务电话：95555

网址： [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(7)平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：孙建一

电话：(0755) 82080387

传真：(0755) 82080386



客户服务电话：95511

网址：bank.pingan.com

(8) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼

法定代表人：胡平西

电话：0086-21-38576709

传真：0086-21-50105085

客户服务电话：(021) 962999

网址：www.srcb.com

(9) 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

(10) 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

(11) 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

法定代表人：张跃伟

电话：021-58788678

传真：021-58787698

客户服务电话：400-089-1289

网址：www.e-rich.com.cn



(12) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：95553 4008888001

网址：www.htsec.com

(13) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

网址：www.csc108.com

(14) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

(15) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63080978

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(16) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95525

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(17) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

客户服务电话：4008918918

网址：[www.shzq.com](http://www.shzq.com)

(18) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

客户服务电话：4006989898

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

(19) 华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

客户服务电话：96518

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(20) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(21) 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

(22) 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 I、J 单元

办公地址：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com) [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(23) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区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

客户服务电话：0571-88920897 4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(24) 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](http://www.cifco.net)

(25) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：万建华

电话：(021) 38676798

传真：(021) 38670798

客户服务电话：400-8888-666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(26) 天风证券股份有限公司

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

## (二) 注册登记机构

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道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

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市源泰律师事务所

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、张兰

## (四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：吴港平

电话：（021）22288888

传真：（021）22280000

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、蒋燕华

## 四、基金的名称

本基金名称：华安生态优先股票型证券投资基金

## 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

本基金重点投资于生态保护与生态友好相关的行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。

## 七、基金的投资方向

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A股股票等权益类证券（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等）、债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券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，但需符合中国证监会的相关规定。

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。

本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于生态保护与生态友好相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 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%。

## 八、基金的投资策略

### （一）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在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。

#### 2、股票投资策略

本基金通过对生态保护相关行业和生态友好型行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。

##### （1）生态优先主题的界定

本基金所指的生态优先主题是指那些生产和经营过程中对环境的影响较小或者以改善环境生态作为主业的相关行业。

据此界定，本基金借鉴上海申银万国证券研究所的行业分类方法，将机械设备、纺织服装、信息服务、信息设备、交运设备、电子、医药生物、农林牧渔、食品饮料、餐饮旅游、化工新材料、环保工程与服务等申万一级和二级行业界定为生态优先主题相关行业。未来，本基金管理人可根据整体经济、行业的发展变化以及申万行业分类的调整，动态调整对于生态优先相关行业的定义，以适应经

济社会发展的需要。

## （2）行业配置

生态优先相关的各个行业由于所处的商业周期不同，面临的上下游市场环境也各不相同，因此，其相关行业表现也并非完全同步，在不同行业之间进行资产配置有助于提高基金投资组合的总体收益，配置过程中需要考虑的具体因素如下：

### 1) 经济发展转型因素

在中国经济发展转型的过程中，与本主题相关的各行业所面临的战略机会及出现时点各不相同，本基金将密切跟踪中国经济发展及结构调整的步伐，前瞻性地各个行业间进行布局，以充分分享中国经济发展与结构转型为生态保护和生态友好型行业带来的发展机遇。

### 2) 技术发展因素

技术的发展与变革可能对生态保护和生态友好型行业造成深远的影响，新技术和工艺的出现会很大程度上影响行业和企业生产方法和资源消耗程度，从而影响相关子行业的发展前景。鉴于此，本基金管理人将密切关注相关科学技术领域的最新进展，并重点配置于那些受益于新技术新工艺发展的子行业。

### 3) 政策因素

生态保护和生态友好型行业的发展会受到政府产业政策、环境政策等政策的影响，不同子行业会因为相关政策的出台而面临或正面或负面的影响，本基金管理人将密切跟踪政府政策的变化，重点配置于那些受益于当时政策或者未来政策变化预期的子行业。

### 4) 经济社会因素

随着人均收入水平的提高、人口分布和结构的变化，不同子行业面临的发展机遇各不相同，也会不断的涌现出新的适宜于生态优先主题的新兴行业。本基金管理人将动态地跟踪这些变化，积极配置于符合经济社会发展趋势的相关子行业。

### 5) 市场短期因素

中短期内，各个子行业所面临的市场需求弹性也各不相同，基金管理人将在分析短期宏观经济形势，及子行业产品价格变化的基础上，积极配置于各个阶段

预期收益率较高的子行业。

### (3) 个股选择

在个股选择方面，本基金所界定的符合生态优先要求的上市公司分为以下两个层次：第一个层次是目前已经满足相关条件，被界定为生态优先相关子行业成分股的上市公司；另一个层次是当前仍未被界定为生态优先相关子行业，但是未来生态保护和生态友好型的相关业务可能成为其主要利润来源的上市公司。基金管理人将对两类公司分别进行系统地分析，最终确定投资标的股票，构建投资组合。

#### 1) 第一层次的上市公司

对于目前已被界定为生态优先相关子行业成分股的上市公司，本基金将采用定量与定性相结合的研究方法选择个股。

首先，本基金基于公司财务指标分析公司的基本面价值，选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司。具体的考察指标包括成长性指标（主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流）、盈利指标（毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率）等指标。结合相关财务模型的分析，形成对标的股票的初步判断。

其次，公司投资研究人员将通过案头研究和实地调研等基本面研究方法深入剖析影响公司未来投资价值的驱动因素，重点从以下几个方面进行研究：

①市场竞争格局：企业在市场格局中处于有利位置，有能力进行创新投入和技术改造；

②盈利效率：企业盈利效率较高，财务结构合理，各项财务指标在业内处于领先水平；

③技术升级：企业核心生产技术符合国家科技创新的大政方针和经济社会发展的内在需求且存在技术壁垒；

④公司治理：企业的公司治理结构稳定高效，同时企业家致力于打造企业的核心竞争力，规划公司长远发展；

⑤短期事件：企业是否有诸如整体上市、集团公司优质资产注入、并购重组、股权激励等短期事件对公司未来发展可能会有正面的影响。

#### 2) 第二层次的上市公司



对于当前仍未被界定为生态优先相关子行业,但是未来生态优先相关业务可能成为其主要利润来源的上市公司,除了采用1)中提到的定量和定性分析方法外,还会重点关注该公司的业务构成指标和行业占比指标,分析公司主营业务与生态优先相关业务的比例;生态优先相关业务产生的利润占比;以及该公司生态优先相关业务未来的成长性等。

### 3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。

在选择利率债品种时,本产品将重点分析利率债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的利率债券组合;在选择信用债品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的信用资质,信用资质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约、担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例,捕捉其套利机会。

### 4、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。

### 5、权证投资策略

本基金在实现权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较为稳定的收益。

### 6、资产支持证券的投资

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。

## （二）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于生态保护与生态友好相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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%；

（3）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（8）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（9）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 8%；

（10）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（11）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金

资产净值的 95%，其中有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值的轧差合计不得超过基金资产的 90%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（12）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（13）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（14）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（15）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（16）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（17）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例进行变更的，以变更后的规定为准。法律

法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是另有规定的除外;
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合中国证监会的规定,并履行披露义务。

### (三) 基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 80% 中证 800 指数收益率+20% 中国债券总指数收益率

## 十、基金的风险收益特征

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

## 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2014年10月20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2014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	407,368,137.21	86.41
	其中：股票	407,368,137.21	86.41
2	固定收益投资	10,227,480.00	2.17
	其中：债券	10,227,480.00	2.17
	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	51,325,732.44	10.89
7	其他资产	2,542,102.21	0.54

8	合计	471,463,451.86	100.00
---	----	----------------	--------

## 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	283,250,226.69	61.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,164,680.00	2.87
E	建筑业	4,326,000.00	0.94
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,860,168.00	14.38
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	8,436,000.00	1.84
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	32,331,062.52	7.06
S	综合	-	-
	合计	407,368,137.21	88.92

## 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	300133	华策影视	1,108,747	32,331,062.52	7.06
2	600580	卧龙电气	3,208,139	31,664,331.93	6.91
3	002450	康得新	1,000,000	31,120,000.00	6.79
4	600066	宇通客车	1,700,000	30,991,000.00	6.76
5	002008	大族激光	1,400,000	27,370,000.00	5.97
6	600804	鹏博士	1,500,000	25,230,000.00	5.51
7	002241	歌尔声学	696,501	19,188,602.55	4.19
8	000661	长春高新	180,000	18,410,400.00	4.02
9	002439	启明星辰	700,000	16,940,000.00	3.70
10	002185	华天科技	1,200,000	15,792,000.00	3.45

#### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,227,480.00	2.23
8	其他	-	-
9	合计	10,227,480.00	2.23

#### 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	110020	南山转债	70,000	7,875,700.00	1.72
2	128005	齐翔转债	20,000	2,351,780.00	0.51



## **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。

## **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**

本基金本报告期末投资股指期货。

### **9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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。

## **10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **10.1 本基金投资国债期货的投资政策**

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 本基金投资国债期货的投资评价**

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，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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	336,397.21
2	应收证券清算款	1,988,590.91
3	应收股利	-
4	应收利息	205,779.63
5	应收申购款	11,334.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,542,102.21

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	7,875,700.00	1.72

### 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	300133	华策影视	32,331,062.52	7.06	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。

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 2014 年 6 月 30 日）

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（2013 年 11 月 28 日）起至 2013 年 12 月 31 日	0.00%	0.07%	-2.47%	0.87%	2.47%	-0.80%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	-2.80%	0.68%	-2.83%	0.84%	0.03%	-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 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5 \% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25 \% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费用

本基金在投资人申购时收取申购费。本基金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。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：

单笔申购金额 (M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<300万	1.2%
300万≤M<500万	0.8%
M≥500万	每笔1000元

本基金的申购费用由本基金的投资者承担，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、赎回费用

本基金的赎回费率按持有期递减。赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担，基金管理人将不低于其总额的25%计入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。具体费率如下：

赎回费率（持有期限Y）	
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注：一年指365天，两年为730天，依此类推。

## 3、转换费用

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 =  $\max[(\text{转入基金的申购费} - \text{转出基金的申购费}), 0]$ ，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、基金的开户费用、账户维护费用；
- 2、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 3、《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；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金的证券交易费用；
- 6、基金的银行汇划费用；
- 7、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

### （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；
- 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、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

### （六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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	更新了重要提示的相关内容。
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
五、相关服务机构	1. 更新了部分代销机构的信息； 2. 更新了注册登记机构的法定代表人信息。
九、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、基金的业绩	新增本章节，更新本基金投资业绩至最新。
二十二、其他应披露事项	披露了自 2014 年 5 月 28 日至 2014 年 11 月 28 日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司

二〇一五年一月十日