

华安强化收益债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

(上述 122 页) 在自上次确定后, 通过对债券市场收益率曲线变化的合理预期, 调整组合期限结构策略(主要包括子策略、两策略和梯式策略)。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; 两策略是使投资组合中债券的到期期限集中于两档; 而梯式策略则是将债券到期期限均匀分布。

(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买入收益率较高的债券, 买入收益较高的债券之办法。

(4) 骑乘策略 通过分拆收益率曲线各期限的利差情况, 买入收益率曲线陡峭处所对应的期限债券, 一段时间后, 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持有。

(5) 信用类债券投资策略 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、资产状况、管理水平等因素, 结合具体发行条款, 对债券进行信用评级。内外债的发行策略与投资策略变化, 信用等级不同的债券会造成利差的改变。管理人可以通过内外债评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差策略进行投资。

(6) 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投资价值(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、赎回权的价值大小、基础债券的业绩和成长性、基础债券的流动性等方面进行研究, 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, 并积极寻求各种套利机会, 以获取超额的投资收益。

(7) 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, 在严格筛选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。

3. 2. 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是低风险、高收益的投资品种之一。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, 深入发掘新股价值的同时, 积极参与新股的申购。

(2) 股票二级市场投资策略 本基金可适当参与股票二级市场投资, 增强基金资产收益。本基金股票投资部分将重点投资于具有持续分红特征的股票, 该类股票一般指具有良好稳定的分红政策和意愿, 持续良好的盈利能力和分红能力公司。

本基金将采取“自下而上”的方式精选个股, 选取过去两年连续现金分红且现金股息率(税后)均大于 0 的上市公司形成备选库。在此基础上, 对于纳入备选库的股票, 本基金将全面考察上市公司所处行业的竞争格局、业务发展现状、盈利增长模式、公司治理结构等基本因素, 并围绕盈利能力(PE)、市值(PS)和现金流量(DCE)等估值指标对上市公司的投资价值进行对比, 挖掘具备中长期持续增长或阶段性高速增长, 且股票估值水平偏低的上市公司来构建本基金的核心股票库。

4. 收益风险管理策略 本基金不直接从事二级市场买入权证, 将因持有股票所派发到参与可分离债券一级市场申购而产生的权证。本基金管理人将以价值分析为基础, 在采用价值模型分析其合理定价的基础上, 充分考量可能持有的权证品种的收益率、流动性及风险收益特征, 避免投资风险, 追求较高风险调整后收益。

5. 其他衍生品工具投资策略 本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向, 一旦有新的产品推出市场, 将在届时相应法律制度的框架内, 制订符合本基金投资目标的投资策略, 同时结合对衍生工具的研究, 在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下, 审慎参与衍生品投资。

九、基金的投资业绩比较基准 本基金业绩比较基准: 中国债券综合指数收益率*90%+中证红利指数收益率*10% 中国债券综合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, 其样本范围覆盖银行间市场和交易所市场, 样本券包括国债、金融债、短期融资券、企业债、公司债等所有主要债券品种, 具有广泛的市场代表性, 能够反映债券市场总体走势, 适合作为本基金债券投资部分的业绩比较基准。

中证红利指数是由中证指数有限公司编制, 挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本, 以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走势, 适合作为本基金股票投资部分的业绩比较基准。

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业绩比较基准的指数时, 本基金可以与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征 本基金为债券型基金, 基金的风险与预期收益都低于股票型基金和混合型基金, 高于货币型基金, 属于证券投资基金中较低风险的品种。

十一、基金投资组合报告 基金资产净值及基金资产净值变动情况 基金投资组合报告 基金资产净值及基金资产净值变动情况 基金投资组合报告 基金资产净值及基金资产净值变动情况

2 报告期未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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	72,828,063.50	4.76
CO	食品、饮料	14,651,000.00	0.96
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	19,024,403.64	1.24
C4	石油、化学、塑胶、塑料	25,779,319.10	1.68
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	5,565,358.00	0.36
C7	机械、设备、仪表	5,712,650.50	0.37
C8	医药、生物制品	2,096,332.26	0.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,184,795.40	2.17
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,677,089.27	0.17
H	批发和零售业	589,270.50	0.04
I	金融、保险	40,652,054.08	2.66
J	房地产业	23,620,873.76	1.54
K	社会服务业	1,066,549.02	0.07
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		174,618,665.53	11.41

3 报告期未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	600036	招商银行	2,200,000	32,516,000.00	2.12
2	601668	中国铝业	5,028,643	23,332,903.52	1.52
3	600162	香江控股	3,100,100	22,816,736.00	1.49
4	000895	双汇发展	350,000	14,651,000.00	0.96
5	000778	基智集团	600,000	14,118,000.00	0.92
6	600308	华泰证券	920,287	11,080,258.48	0.72
7	600352	浙江龙盛	1,160,000	9,871,600.00	0.64
8	601618	中国平安	1,771,923	9,851,891.88	0.64
9	601788	光大证券	370,832	8,136,054.08	0.53
10	600966	博汇纸业	850,000	7,055,000.00	0.46

4 报告期未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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	168,122,914.00	10.98
2	央行票据	336,124,000.00	22.09
3	国债期货	85,200,000.00	5.56
其中: 政策性金融债		85,200,000.00	5.56
4	企业债	612,196,458.13	39.99
5	企业短期融资券	373,208,883.63	4.79
6	可转债	1,277,063,690.96	83.41
7	其他	-	-
8	合计	1,277,063,690.96	83.41

5 报告期未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	0801017	08央票 17	1,000,000	103,410,000.00	6.75
2	0801011	08央票 11	1,000,000	103,320,000.00	6.75
3	080707	08国债(7)	1,000,000	98,160,000.00	6.41
4	080210	08国债(10)	800,000	85,200,000.00	5.56
5	010112	21国债(2)	824,700	84,937,806.00	5.55

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580027	长虹 CWB1	257,086	711,359.96	0.05

8 投资组合报告附注 8.1 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不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	862,371.68
2	应收证券清算款	188,305,994.35
3	应收股利	-
4	应收利息	17,338,594.23
5	应收申购款	7,132,556.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	213,439,617.20

8.4 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	110003	新钢转债	17,833,912.20	1.16
2	125960	锡业转债	13,551,076.88	0.89
3	125709	华鼎转债	6,136,550.35	0.40
4	110598	十大转债	4,361,100.00	0.28

8.5 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	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	601668	中国铝业	23,332,903.52	1.52	网下申购新股
2	601618	中国平安	9,851,891.88	0.64	网下申购新股
3	601788	光大证券	8,136,054.08	0.53	网下申购新股

十二、基金的投资 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。基金的投资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。

(一) 基金净值表现 历史各时间段基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较 (截止时间 2009 年 6 月 30 日)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至 2009 年 6 月 30 日	0.90%	0.08%	1.41%	0.17%	-0.51%	-0.09%

华安强化收益债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
自基金合同生效以来至 2009 年 6 月 30 日	0.80%	0.08%	1.41%	0.17%	-0.61%	-0.09%

基金的投资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 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.7%×当年天数 H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等, 支付日期顺延。

2. 托管费 本基金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 为前一日基金资产净值 基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等, 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用于本基金的营销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×0.4%×当年天数 H 为 B 类基金份额每日计提的销售服务费 E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值 销售服务费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出, 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。 本基金 A 类基金份额申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如有多笔申

四川天一科技股份有限公司有限限条件的流通股上市公告

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。

重要提示: ● 本次有限条件的流通股上市数量为 48,768,847 股 ● 本次有限条件的流通股上市时间为 2009 年 12 月 3 日

一、公司股权分置改革方案的基本情况 四川天一科技股份有限公司(简称“天科股份”或“公司”)以原有流通股本 76,050,000 股为基数, 用资本公积金向方案实施日登记在册的全体流通股股东转增股本, 非流通股股东以其所获转增股本抵消其非流通股股份。公司于 2007 年 9 月 8 日公告《股权分置改革方案》, 并于 2007 年 10 月 16 日, 公司收到深圳证券交易所审核通过的《股权分置改革方案实施后首个交易日, 公司的流通股股份获得上市流通权。

公司股权分置改革方案于 2006 年 10 月 30 日经公司 2006 年第一次临时股东大会暨相关股东大会审议通过, 以 2006 年 11 月 7 日作为股权登记日实施, 于 2006 年 11 月 9 日实施后首次复牌。

二、公司股权分置改革方案中追加对价的实施情况 公司股权分置改革方案无追加对价安排。

二、公司的股东在股权分置改革方案中有承诺的履行情况 公司股权分置改革方案中关于有限条件的流通股上市流通有关承诺: 天科股份流通股股东根据中国证监会《上市公司股权分置改革管理办法》的规定做出了法律承诺, 经保荐机构核查, 相关股东严格履行了在股权分置改革中所做出的各项承诺。

三、公司自股改实施后至今股本结构变化及股东持股变动情况 1. 股改实施后至至今公司股本结构的变化情况 (1) 公司无因发行新股、送股等导致的股本结构变化。

(2) 公司无因发行新股(增发、配股、非公开发行)、可转换债券、回购股份等导致的股本结构变化。

2. 股改实施后至今, 公司股东持有有限条件流通股变化情况 (1) 股权转让 2007 年 5 月 14 日, 中国昊华化工(集团)总公司召开总经理办公会议, 就转让西南化工研究院设计研究院股权事宜进行了研究。昊华集团全资子公司西南化工研究院设计院签署了《国有股权转让协议》。中国昊华化工(集团)总公司向其控股子公司中国化工集团公司传达了《关于上划四川天一科技股份有限公司的请示》(中昊发字(2007)152 号), 中国化工集团公司于 2007 年 5 月 15 日出具了《关于划转四川天一科技股份有限公司的批复》, 同意上划地方国有股权划转事宜。公司于 2007 年 9 月 8 日公告《股权转让协议书》, 2007 年 10 月 16 日, 公司收到深圳证券交易所审核通过的《股权分置改革方案实施后首个交易日, 公司的流通股股份获得上市流通权。

2. 无限售条件股份 1、人民币普通股 196,845,444 48,768,847 245,614,291 2、限售条件股份合计 196,845,444 48,768,847 245,614,291 三、股份变动情况 2. 保荐机构及保荐代表人变更情况 2007 年 10 月 12 日, 公司发布《关于调整股权分置改革保荐机构公告》, 公司原保荐机构西南证券有限责任公司因中国证监会核准上市公司股权分置改革后指导的关联交易, 经协商一致, 公司已与西南证券有限责任公司解除相关协议, 并与西南证券签署了《股权分置改革持续督导保荐协议》, 公司保荐机构变更为西南证券, 保荐代表人变更为栗建刚。

七、结论性意见 经核查, 西南证券认为, 持有有限条件的有限条件的流通股股东均履行了在股权分置改革中所作出的各项承诺; 天科股份此次有限条件流通股上市, 符合《上市公司股权分置改革管理办法》中的有关规定, 此次限售股份上市, 因股改而形成的限售股份已全部依法履行, 流通股和有限条件的流通股上市公告中披露股改实施后至今公司股本结构变化和股份持股变动情况的披露真实、准确、完整。

特此公告 四川天一科技股份有限公司董事会 2009 年 11 月 26 日

备查文件: 1. 公司董事会有限条件的流通股上市流通申请报告 2. 保荐机构核查意见书 3. 其他文件

国联安基金管理有限公司 关于旗下基金增加广发华福证券为代销机构的公告

根据国联安基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与广发华福证券有限责任公司(以下简称“广发华福证券”)签署的国联安基金管理有限公司开放式证券投资基金销售服务协议, 自 2009 年 11 月 27 日起, 广发华福证券所有营业网点代理国联安德盛稳健投资基金(简称: 国联安德盛稳健基金代码: 255010)、国联安德盛小盘精选证券投资基金(简称: 国联安小盘精选基金 基金代码: 257010)、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金(简称: 国联安安心成长基金 基金代码: 253010)、国联安德盛精选股票证券投资基金(简称: 国联安精选股票基金代码: 前 250720 后 250701)、国联安主题驱动股票型证券投资基金 基金代码: 257050)、国联安德盛优势股票证券投资基金(简称: 国联安优势股票基金 基金代码: 前 250730 后 250703)、国联安德盛红利股票证券投资基金(简称: 国联安红利股票基金 基金代码: 前 250740 后 250704)及国联安德盛增利债券证券投资基金(简称: 国联安增利债券基金 基金代码: A 类 253020 B 类 253021)的销售及相关业务, 今后广发华福证券若代理本公司其他基金销售及相关业务, 将另行公告。

投资者欲了解上述基金的详细信息, 请登录本公司网站查询相关基金招募说明书或拨打本公司客户服务热线咨询有关基金的详情。

销售期间, 投资者可以通过以下途径了解或咨询相关情况: 1. 国联安基金管理有限公司 国联安基金管理有限公司客户服务热线: 021-38784766、400-7000-366(免长途话费) 国联安基金管理有限公司网站: http://www.gtja-allianz.com

2. 广发华福证券有限责任公司 广发华福证券客户服务热线: 0691-96326 广发华福证券网站: http://www.gtfzq.com.cn/Stat/ 欢迎广大投资者垂询, 办理本公司旗下的开放式基金的开户、认(申)购和赎回等相关业务。 特此公告。

国联安基金管理有限公司 二〇〇九年十一月二十七日

青海金瑞矿业发展股份有限公司 股票交易异动公告

公司董事会及全体董事保证本公告