（上接B61版）

（1）基金管理人应按基金合同的约定在保本周期到期日后20个工作日内向基金份持有人履行保本差额的支付义务；基金管理人无法全额履行保本义务的，基金管理人在保本周期到期日后5个工作日内向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将需代偿的款项划入本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人支付给基金份额持有人。

（2）担保人将上述代偿款项全额划入本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责。资金到账后，基金管理人应按照基金合同的约定进行分配和支付。

（3）发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。

2、本基金第一个保本周期后各保本周期的保本保障机制按基金管理人与担保人届时签订的保证合同或与保本义务人签订的风险买断合同确定。涉及修改上述保本周期到期赔付的，基金管理人在当期保本周期开始前公告。

（五）本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并转入下一保本周期。

1、过渡期及过渡期申购

基金管理人有权视其业务需要设定过渡期，到期操作期间截止日次个工作日起至下一个保本周期开始日前一工作日的时间为过渡期。过渡期最长不超过20个工作日。

投资人在过渡期内申请购买本基金基金份额或者转换入本基金的行为称为“过渡期”申购。

（1）基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期担保额度或保本额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制方法。

（2）过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市后本基金基金份额净值计算。

（3）过渡期申购费率

过渡期申购费率最高不超过5%，具体费率在届时的临时公告或更新的基金招募说明书中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资人承担，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。

（4）过渡期申购的具体费率、日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。

过渡期内，基金管理人有权暂停办理本基金的日常赎回、转换出业务。

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。

（5）投资人进行过渡期申购的，其持有相应基金份额至过渡期最后一日（含该日）期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

（6）本基金过渡期内，除暂时无法变现的基金财产外，基金管理人应使基金财产保持为现金。

2、下一保本周期基金资产的形成

对于投资者在到期操作期间选择或默认选择转入下一保本周期、或在过渡期申购的基金份额，转入下一保本周期的转入金额等于相应基金份额在下一保本周期开始前一日（即折算日）所对应的基金资产净值。

3、基金份额折算

下一保本周期开始日前一日为基金份额折算日。

在基金份额折算日，基金份额持有人所持有的基金份额（包括投资人过渡期申购的基金份额、保本周期结束后默认选择转入下一保本周期的基金份额）在其所代表的资产净值总额保持不变的前提下，基金份额净值折算调整为1.00元，基金份额数额按折算比例相应调整。

在基金份额持有人赎回基金份额时，持有期的计算仍以投资人认购、申购、转换入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算，不受基金份额折算的影响。

4、开始下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。基金管理人以过渡期申购和/或从上一保本周期转入的基金份额在折算日所代表的资产净值确定为本基金转入下一保本周期时的基金资产。

基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间默认选择转入下一保本周期的基金份额和/或过渡期申购的基金份额，经基金份额折算后，适用下一保本周期的保本条款。

自本基金下一保本周期开始后，本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过3个月。

（六）转为“财通收益增强债券型证券投资基金”资产的形成

保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金转型为“财通收益增强债券型证券投资基金”。

1、对于投资者在到期操作期间默认选择转入转型后的“财通收益增强债券型证券投资基金”的基金份额，转入金额等于相应基金份额在“财通收益增强债券型证券投资基金”基金合同生效日前一日所对应的基金资产净值。

2、保本周期届满，如本基金转型为“财通收益增强债券型证券投资基金”，则基金管理人可在其转型之日起不超过3个月的时间区间内开放其申购、赎回等业务，具体操作办法及规则由基金管理人提前予以公告。

（七）保本周期到期的公告

1、保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金将继续存续。基金管理人应依照法律法规规定就本基金继续存续及过渡期申购的相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金将转型为“财通收益增强债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《财通收益增强债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。

3、在保本周期到期前，基金管理人将进行提示性公告。

十二、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

每个保本周期开始日（在第一个保本周期内为基金成立日）中国人民银行确定的三年期银行定期存款税后收益率

本基金选择三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准的原因如下：

本基金是保本型基金，保本周期为三年，保本但不保证收益率。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

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股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更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。

十三、风险收益特征

本基金为保本混合型产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

十四、变更后的“财通收益增强债券型证券投资基金”的投资

1、投资目标

在保持资产流动性和严格控制风险的基础上，综合利用多种投资策略，实现基金资产的长期稳定增值。

2、投资范围

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持债券、可转换债券、分离交易可转换债券、债券回购等）、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或中国证监会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。

本基金的投资组合比例有如下限制：债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

3、投资策略

（1）资产配置策略

本基金定位为债券型基金，其长期战略性资产配置以债券为主。同时，在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、公司基本面、市场估值水平以及投资者情绪，在一定的范围内对债券、股票和现金各自的投资比例作战术性资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。

（2）债券资产投资策略

本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，主要投资策略包括债券投资组合策略和动态品种优化策略。

1）债券投资组合策略

i）目标久期管理

本基金将根据宏观经济和金融市场的运行情况以及国家财政货币政策动向等因素，定期对各个关键期限利率的变化做出合理判断。在此基础上，本基金将对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低可能的利率变化给组合带来的损失。

ii）收益率曲线策略

在组合久期不变的条件下，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，以期在收益率曲线调整的过程中增强基金的收益。

2）动态品种优化策略

本基金依据对类属资产和个券的相对投资价值评估，构建并动态调整安全资产组合中的类属资产配置和具体投资品种构成，以不断提高组合收益率。

i）类属资产配置策略

通过分析各类属资产的相对收益和风险因素，确定不同债券种类的配置比例。主要决策依据包括对未来宏观经济和利率环境的研究和预测、利差变动情况、市场容量、信用等级情况和流动性情况等。通过情景分析的方法，判断各个债券类属的预期持有期回报，在不同债券类属之间进行配置。

ii）个券选择策略

在个券选择过程中，本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收益率情况，综合判断个券的投资价值，选择风险收益特征最匹配的品种，构建具体的个券组合。

iii）可转换债券投资策略

可转换债券同时具备了普通股票所不具备的债性特征和普通债券不具备的股性特征：当其正股下跌时，可转换债券的价格可以受到债券价值的支撑；当其正股上涨时，可转换债券的内含看涨期权可使其分享股价上涨带来的收益。本基金将首先选择那些转股溢价率和纯债溢价率呈现“双低”特征的可转换债券品种，较低的转股溢价率保证了可转换债券在其正股上涨时的涨幅同步性较强，而较低的纯债溢价率则使其正股下跌时的最大损失率也较低。对这些具备“双低”特征的可转换债券，本基金将进一步对其正股的投资价值进行深入分析，选择那些正股具有投资价值的可转换债券进行重点投资。

iv）资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，本基金将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（3）股票投资策略

本基金以价值投资为基本投资理念，结合定性分析与定量分析的结果，以价值选股、组合投资为原则，选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票构建本基金的股票投资组合。

本基金将通过选择高流动性股票保证组合的高流动性，并通过分散投资降低组合的个股集中度风险，以保证在股票市场系统风险增加时，可实现股票组合的快速变现，并及时转入安全资产组合，规避市场系统风险。

（4）权证投资策略

本基金在权证投资方面主要运用的策略包括：价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，本基金将结合自身资产状况进行审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。

（5）其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例，谨慎投资。

4、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）债券等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%；

2）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；

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）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%；

9）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%；

10）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%；

11）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%；

12）本基金应投资于信用级别评级为AA-以上（含AA-）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；

13）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；

14）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%，债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

15）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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。

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，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）向他人贷款或者提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是中债综合指数收益率。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本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），是中国目前最权威、应用也最广的指数。中债综合指数反映了债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

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的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更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。

6、风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十五、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,577,045.40	6.44
	其中：股票	22,577,045.40	6.44
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	300,687,161.80	85.75
	其中：债券	300,687,161.80	85.75
	资产支持证券	–	–
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	20,069,064.85	5.72
7	其他各项资产	7,330,924.35	2.09
8	合计	350,664,196.40	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	487,940.00	0.16
B	采矿业	–	–
C	制造业	2,105,371.20	0.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,077,300.00	0.36
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	11,708,842.20	3.91
J	金融业	–	–
K	房地产业	2,248,656.00	0.75
L	租赁和商务服务业	1,273,000.00	0.42
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	3,675,936.00	1.23
S	综合	–	–
	合计	22,577,045.40	7.54

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金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300027	华谊兄弟	47,200	3,675,936.00	1.23
2	300002	神州泰岳	93,300	3,583,653.00	1.20
3	300017	网宿科技	56,664	3,229,848.00	1.08
4	000732	泰禾集团	189,760	2,248,656.00	0.75
5	300059	东方财富	84,000	1,800,120.00	0.60
6	603000	人民网	17,300	1,624,470.00	0.54
7	300315	掌趣科技	64,620	1,470,751.20	0.49
8	300349	金卡股份	32,528	1,460,507.20	0.49
9	300058	蓝色光标	19,000	1,273,000.00	0.42
10	002524	光正集团	190,000	1,077,300.00	0.36

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	29,898,000.00	9.98
	其中：政策性金融债	29,898,000.00	9.98
4	企业债券	187,366,669.80	62.54
5	企业短期融资券	39,973,000.00	13.34
6	中期票据	19,836,000.00	6.62
7	可转债	23,613,492.00	7.88
8	其他	–	–
9	合计	300,687,161.80	100.37

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	124334	13博国资	200,000	20,290,000.00	6.77
2	1380258	13黔南债	200,000	20,064,000.00	6.70
3	1380238	13楚璀发展债	200,000	20,014,000.00	6.68
4	130201	13国开01	200,000	19,950,000.00	6.66
5	122819	11常城建	150,000	15,132,000.00	5.05

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1、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合约。

8.2、本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1、本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

9.2、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合约。

9.3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

10、投资组合报告附注

10.1、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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.2、报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

10.3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	222,832.18
2	应收证券清算款	1,692,293.55
3	应收股利	–
4	应收利息	5,415,798.62
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,330,924.35

10.4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	14,683,500.00	4.90
2	110022	同仁转债	6,158,592.00	2.06
3	110017	中海转债	2,771,400.00	0.93

9.5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002524	光正集团	1,077,300.00	0.36	增发流通受限
2	300315	掌趣科技	1,470,751.20	0.49	重大资产重组

10.6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十六、基金的业绩

本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，投资者在做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

1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2012年12月20日至2012年12月31日	0.10%	0.04%	0.14%	0.01%	-0.04%	0.03%
2013年1月1日至2013年6月30日	-0.70%	0.18%	2.16%	0.02%	-2.86%	0.16%
2013年7月1日至2013年9月30日	2.41%	0.17%	1.09%	0.01%	1.32%	0.16%
2012年12月20日至2013年9月30日	1.80%	0.17%	3.42%	0.01%	-1.62%	0.16%

注：（1）上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；

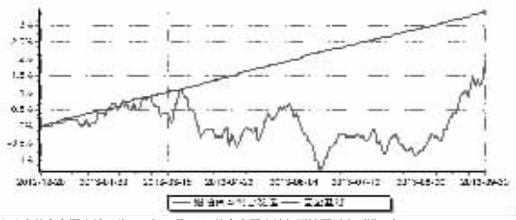
（2）本基金业绩比较基准为：每个保本周期开始日（在第一个保本周期内为基金成立日）中国人民银行确定的三年期银行定期存款税后收益率。

（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通保本混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012年12月20日-2013年9月30日）



注：（1）本基金合同生效日为2012年12月20日，基金合同生效起至披露时点不满一年；

（2）本基金股票、权证等权益类占基金资产：≤40%；债券、货币市场工具、现金及其他资产占基金资产：≥60%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产：≥5%；权证占基金资产：≤3%。本基金的建仓期为2012年12月20日至2013年6月20日，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

十七、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、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。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

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1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.20%÷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，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、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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“财通收益增强债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法同上。

上述“一、基金费用的种类中第3—7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当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）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。

（四）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。

十八、对招募说明书更新部分的说明

1、“重要提示”部分

（1）更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日期信息。

2、“三、基金管理人”部分

（1）本报告期内，公司股东“财通证券有限责任公司”于2013年10月名称变更为“财通证券股份有限公司”，“杭州市工业资产经营投资集团有限公司”于2013年8月名称变更为“杭州市实业投资集团有限公司”。

（2）更新了主要人员情况。

3、“四、基金托管人”部分

（1）更新了主要人员情况；

（2）更新了基金托管业务经营情况；

4、“五、相关服务机构”部分

（1）更新了代销机构方面信息。

5、“八、基金份额的申购与赎回”部分

（1）更新了本公司网上交易系统办理基金申购业务的单笔最低金额限制。

6、“十一、基金的投资”部分

（1）更新了基金投资组合报告，报告所载数据截至2013年9月30日。

7、“十二、基金的业绩”部分

（1）更新了基金业绩表现数据。

8、“二十五、其他应披露事项”部分

（1）更新了2013年6月1日至2013年12月1日期间涉及基金的相关公告。

财通基金管理有限公司

二〇一四年一月三十日

（上接B62版）

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

103）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

邮政编码：200235

注册资本：人民币伍千万元

法定代表人：其实

电 话：021-54509998

传 真：021-64385308

104）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：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室

邮政编码：200120

法定代表人：杨文斌

电 话：021-58870011

传 真：021-68596919

105）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号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：http://www.fund123.cn/

106）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

107）浙江同花顺基金销售有限公司

地 址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

邮 编：310012

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

传 真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

或访问同花顺旗下基金网站——爱基金网 www.5ifund.com

108）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

邮政编码：100029

法定代表人：闫振杰

电 话：010-62020088

传 真：010-62020088-8002

109）中期时代基金销售（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

法定代表人：路瑶

电话：010-65807865

传真：010-65807868

客服电话：95162 4008888160

网址：www.cifcofund.com

110）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼

法定代表人：盛大

电话：021-50583533-3006

传真：021-50583633

客服电话：400-005-6355

网址：www.leadfund.com.cn

111）泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室

法定代表人：于海锋

电话：028-82000996

传真：028-82000996-805

客服电话：4008-588-588

网址：http://www.pyfund.cn/

112）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

公司网站：http://www.yixinfund.com

服务热线：400-6099-500

客服邮箱：service@yixinfund.com

113）万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

法定代表人：李招弟

电话：010-59393923

传真：010 -59393074

客服电话：400-808-0069

网址：www.wy-fund.com

114）北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室

法定代表人：罗初安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

联系人：孙晋峰

网址：www.zcvc.com.cn

客户服务电话：400-001-8811

115）深圳腾元基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407

服务热线：4006 877 899

联系方式：0755-3337 6922

传真号码：0755-3306 5516

邮政编码：518000

客服邮箱：service@tenyuanfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：汇添富基金管理股份有限公司住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室

办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼21楼

法定代表人：林利军

电话：（021）28932878

传真：（021）28932876

联系人：王小栋

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东东方昆仑律师事务所上海分所

住所：上海市延安西路728号华敏·翰尊国际大楼13楼F座

负责人：陈冉

电话：（021）62113098

传真：（021）62112108

经办律师：田卫红、汪年俊

联系人：田卫红

（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（特殊普通合伙）

首席合伙人：吴港平

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16层

办公地址：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16层

邮政编码：100738

公司电话：（010）58153000

公司传真：（010）85188298

签字会计师：徐艳、汤毅

业务联系人：汤毅

四、基金的名称

本基金名称：汇添富策略回报股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为契约型开放式股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金采用“自上而下”的投资方式，灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略，构建有效的投资组合，并在科学严格的投资风险管理前提下，力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。

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股票、债券、货币市场工具、权证、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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、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证券品种占基金资产的5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金为股票型基金，以股票投资为主。

股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险，行业轮动策略用于把握行业基本面变化以精选优势行业，个股精选策略用于挖掘各行业中的优质股票以获取超额收益。

另外，由于本基金还可投资于债券、权证，因此投资策略还包括债券投资策略和权证投资策略。

1、资产配置策略

本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策，政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财务政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场P/E与历史平均水平的偏离程度），结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在有效控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

2、行业轮动策略

本基金在股票投资过程中注重行业轮动策略的应用。

首先，本基金在分析和总结国内外历史上主要宏观经济周期不同阶段（衰退、复苏、过热和滞胀）的行业景气轮动规律与国内外股票市场不同阶段（牛市、熊市）的行业轮动规律基础上，结合对当前中国经济和资本市场特征的研究，精选契合当前宏观经济发展趋势和资本市场偏好的潜在优势行业。

然后，在这些潜在的优势行业中，本基金从历史估值比较（量化指标包括但不限于PE、PB、PEG，其中，周期性行业以PB为主，非周期性行业以PE为主）和未来发展趋势（量化指标包括但不限于净利润同比增长率、主营业务收入增长率、毛利率、存货周转率）两方面进行深入分析，研判这些行业在其自身景气周期变化中所处的时点，并考察多种环境因素（诸如新进入者的威胁、替代品的威胁、购买者的议价能力、供应者的议价能