(上接B29版)
联系人:王霈霈
联系电话:95548
公司网站:www.bigsun.com.cn
104)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:李丹
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:021-68604866
公司网址:www.bocichina.com
105)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
联系人:程月艳
联系电话:0371-65585670
联系传真:0371-65585665
客服电话:967218(郑州市外客户需要加拨区号0371)、400-813-9666
网址:www.ccnew.com
106)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701邮编:100032
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层邮编:100033
法定代表人:林义相
联系电话:010-66045608
客服电话:010-66045678
传真:010-66045549
联系人:林爽
天相基金网网址:www.jjm.com.cn
107)江苏金百临投资咨询有限公司
注册地址:无锡市滨湖区锦溪路99号
办公地址:无锡市滨湖区锦溪路99号
邮政编码:214125
法定代表人:费晓燕
电话:0510-82758877
传真:0510-88555858
108)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
公司地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
法定代表人:马令海
订购热线:4009-945-899
客服中心:0755-88399099
传真号码:0755-88394677
新兰德网站:http://www.new-rand.cn/
109)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客服电话:400-920-0022
联系人:周轶
电话:021-20835789
传真:021-20835885
网址:licaike.hexun.com
110)厦门市鑫鼎盛证券投资咨询服务有限公司
111)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801
邮政编码:200120
法定代表人:汪静波
电话:021-38600735
传真:021-38509777
112)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单元邮编:518001
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I,J单元邮编:518001
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
113)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
114)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
115)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/
116)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
117)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
118)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
119)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
120)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
121)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/
122)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
123)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
124)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:罗细安
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
125)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:4006877899
联系方式:0755-33376922
传真号码:0755-33065516
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)28932888
传真:(021)28932998
联系人:王小练
(三)律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:吕红、安冬
联系人:吕红
(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
签章会计师:徐艳、汤骏
业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富社会责任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

精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。

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%,基金保留的现金或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%。
本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的80%。

八、基金的投资策略

(一)投资策略
本基金为股票型基金,股票投资的主要策略包括资产配置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;个股精选策略用于挖掘积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。
1、资产配置策略
本基金管理人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等),结合全球宏观经济形势,研判国内经济的发展趋势,并在严格管理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、个股精选策略
本基金股票投资采用"自下而上"的个股精选策略,精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司。为了深刻理解投资对象的特征,持之以恒地贯彻和保持本基金股票投资风格,本基金管理人应用过滤模型来动态建立和维护核心股票库,审慎精选,严格高效管理风险,力求实现本基金投资目标。
首先,在全部股票中,按照本基金投资范围的界定,本基金管理人投资管理制度要求以及股票投资限制,剔除其中不符合投资要求的股票(包括但不限于法律法规或公司制度明确禁止投资的股票、筹码集中度高且流动性差的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等),筛选得到的公司组成本基金的初选股票库。初选股票库将不定期地更新。
其次,基于初选股票库,本基金管理人从利益相关者责任(包括但不限于上市公司对股东、债权人、职工、国家等的责任)和资源、环境责任(包括但不限于上市公司对生态环保承担的责任)等方面,将净资产收益率、资产负债率、职工获益率、资产纳税率、单位净利润废物排放量等定义为本基金所关注的社会责任指标。各指标具体计算公式如下:
净资产收益率 = 上市公司净利润 ÷ 上市公司平均净资产 × 100%,
资产负债率 = 上市公司负债总额 ÷ 上市公司资产总额 × 100%,
职工获益率 = 上市公司支付职工工资、福利及社保基金总额 ÷ 上市公司营业收入总额 × 100%,
资产纳税率 = 上市公司企业纳税总额 ÷ 上市公司平均资产总额 × 100%,
单位净利润废物排放量 = 上市公司年废物排放量 ÷ 上市公司年净利润 × 100%。
根据上述社会责任指标,本基金管理人对备选股票进行动态综合评级,选择排名在前1/3的上市公司作为积极履行社会责任的上市公司。
在此基础上,本基金管理人通过扎实的案头研究和详尽紧密的实地调研,结合卖方研究的分析,从信息披露、重要股东状况、激励约束机制等方面衡量公司治理结构,从管理层稳定性、工作能力、品行等方面考察管理层,从经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等方面评估竞争优势,从中选择具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,组成本基金的精选股票库。
然后,在精选股票库的基础上,本基金管理人从内在价值、相对价值、收购价值等方面,考察市盈增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、企业价值/息税、折旧、摊销前利润(EV/EBITDA)、自由现金流贴现(DCF)等一系列估值指标,从中选择估值水平相对合理的公司,组成本基金的核心股票库。
最后,基金经理按照本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据二级市场波动情况构建股票组合并动态调整。
3、债券投资策略
本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性,在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上,灵活运用各种消极和积极策略。
消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造一个恰当的债券组合,使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。这样无论市场利率如何变化,债券组合都能获得一个比较确定的收益率。
积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别,它决定于三个要素:货币市场利率、均衡真实利率和预期通货膨胀率。在深入分析利率期限结构的基础上,本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投资。
本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。国内债券市场正处于发展阶段,交易制度、债券品种体系和投资者结构也在逐步完善,这些结构变化会产生低风险甚至无风险的套利机会。本基金将借助经济理论和金融分析方法努力把握市场结构变化所带来的影响,并在此基础上寻求低风险甚至无风险的套利机会,主要通过跨市场套利策略和跨品种套利策略来完成。
4、权证投资策略
本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收益特征,有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。
5、资产支持证券投资策略
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。
(二)投资决策依据和投资程序
1、投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
(2)国内外宏观经济形势及对中国证券市场的影响;
(3)国家货币政策、产业政策以及证券市场政策;
(4)行业发展现状及前景;
(5)上市公司基本面;
(6)股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。
2、投资决策机制
本基金实行投资决策团队制,强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合,设立了投资研究部,策略分析师、行业分析师、金融工程小组和基金经理立足本职工作,充分发挥主观能动性,渗透到投资研究的关键环节,群策群力,为基金份额持有人谋取中、长期稳定的较高投资回报。
3、投资决策程序
本基金投资决策流程为:
(1)策略分析师就宏观、政策、投资主题、市场环境提交策略报告并讨论;行业研究员就行业发展趋势和行业组合的估值比较,召开会议讨论确定行业评级;
(2)基金经理在策略会议的基础之上提出资产配置的建议;
(3)投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议,并确定资产配置比例的范围;
(4)投资研究部提交股票库,在此基础上,基金经理、行业研究员决定核心股票库名单;
(5)基金经理在考虑资产配置的情况下,经过风险收益的权衡,决定投资组合方案;
(6)投资总监审核投资组合方案后,交由基金经理实施;
(7)集中交易室执行交易指令;
(8)金融工程小组进行全程风险评估和绩效分析。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:
沪深300指数收益率 × 80% + 中证全债指数收益率 × 20%
选择该业绩基准,是基于以下因素:
1、沪深300指数编制合理、透明,有一定市场覆盖率,并且不易被操纵;
2、沪深300指数编制和发布有一定的历史,有较高的知名度和市场影响力;
3、沪深300指数是中证指数公司编制共同推出的沪深两个市场第一个统一指数;
4、中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成;
5、基于本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。
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,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16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10月1日起至12月31日止。

投资组合报告

1.1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	1,313,160,670.96	90.51
	其中:股票	1,313,160,670.96	90.51
2	固定收益投资	49,590,000.00	3.42
	其中:债券	49,590,000.00	3.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	33,961,045.49	2.34
6	其他资产	54,098,166.29	3.73
7	合计	1,450,809,882.74	100.00

1.2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	18,792,876.90	1.33
C	制造业	1,130,555,322.43	80.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,077.68	0.00
E	建筑业	23,701,012.40	1.68
F	批发和零售业	28,520,918.37	2.02
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	55,426,346.18	3.93
J	金融业	18,686,837.93	1.32
K	房地产业	35,597,053.59	2.52
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	1,872,225.48	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,313,160,670.96	93.01

1.3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	002241	歌尔声学	3,681,955	129,162,981.40	9.15
2	002635	安洁科技	3,576,951	128,054,845.80	9.07
3	002236	大华股份	2,680,398	109,574,670.24	7.76
4	600389	江山股份	2,256,673	88,303,614.49	6.25
5	002007	华兰生物	2,796,869	80,270,140.30	5.69
6	002049	同方国芯	1,605,610	79,285,021.80	5.62
7	300177	中海达	2,149,925	57,510,493.75	4.07
8	002475	立讯精密	1,651,751	55,201,518.42	3.91
9	300045	华力创通	2,207,415	54,964,633.50	3.89
10	000915	山大华特	1,500,317	46,074,735.07	3.26

1.4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	49,590,000.00	3.51
	其中:政策性金融债	49,590,000.00	3.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	49,590,000.00	3.51

1.5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

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	130227	13国开27	500,000	49,590,000.00	3.51

1.6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。
1.7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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.8报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.8.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:报告期末本基金无股指期货持仓。
1.8.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期内未投资股指期货。
1.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.9.1本期国债期货投资政策
本基金本报告期内未投资国债期货。
1.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:报告期末本基金无国债期货持仓。
1.9.3本期国债期货投资评价
本基金本报告期内未投资国债期货。
1.10投资组合报告附注
1.10.1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、处罚的情况。
1.10.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
1.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,166,231.35
2	应收证券清算款	51,854,826.51
3	应收股利	-
4	应收利息	907,805.21
5	应收申购款	169,303.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,098,166.29

1.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。
1.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

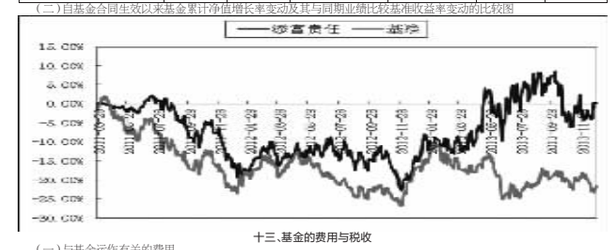
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002004	华邦颖泰	30,120,000.00	2.13	非公开发行

十二、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)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①1	净值增长率标准差②2	业绩比较基准收益率③3	业绩比较基准收益率标准差④4	(1)-(3)	(2)-(4)
2011年3月29日(基金合同生效日)至2011年12月31日	-15.60%	0.75%	-21.85%	1.02%	6.25%	-0.27%
2012年1月1日至2012年12月31日	2.13%	1.07%	6.75%	1.02%	-4.62%	0.05%
2013年1月1日至2013年12月31日	16.13%	1.63%	-6.02%	1.12%	22.15%	0.51%
2011年3月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	0.10%	1.23%	-22.19%	1.06%	22.29%	0.17%

(二)自基金合同生效以来基金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图



十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用
1、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)基金合同生效后的信息披露费用;
(4)基金份额持有人大会费用;
(5)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
(6)基金的证券交易费用;
(7)基金财产拨划支付的银行费用;
(8)按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
2、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
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数(本基金年管理费率为1.50%)
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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,支付日期顺延。
(2)基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数(本基金年托管费率为0.25%)
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(3)上述"(一)基金费用的种类"中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
3、不列入基金费用的项目
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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。
4、费用的调整
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有关规定最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。
5、基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。
(二)与基金销售有关的费用
(1)申购费用
基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章"基金的申购与赎回"相应内容。
(2)赎回费用
基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章"基金的申购与赎回"相应内容。
(3)转换费用
基金转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章"基金的申购与赎回"相应内容。

十四、对招募说明书更新部分的说明

一、"重要提示"部分:
更新了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。
二、"三、基金管理人"部分:
更新了主要人员情况。
三、"四、基金托管人"部分:
更新了证券投资基金托管情况。
四、"五、相关服务机构"部分:
更新了基金份额发售机构的相关信息。
五、"九、基金的投资"部分:
更新了基金投资组合报告。
六、"十、基金的业绩"部分:
更新了基金业绩表现数据。
七、"十二、其他应披露事项"部分:
更新了2013年9月30日至2014年3月29日期间涉及基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司
2014年5月12日

(上接B30版)
(43)上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人:其实
电话:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn
(44)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68号8楼
法定代表人:汪静波
电话:400-821-5399
传真:021-38509777
网址:www.noah-fund.com
(45)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
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
电话:021-58788678
网址:www.e-rich.com.cn
(46)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市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
客服电话:0571-88920897 4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com
(47)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
法定代表人:闫振杰
客服电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com
(48)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
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢2层
法定代表人:路瑶
客服电话:95162,4008888160
网址:www.cifcofund.com
(49)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
办公地址: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
客服电话:4008080069
网址:www.wy-fund.com
(50)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:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I,J单元
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn www.jjmmw.com
(二)注册登记机构
名称:华安基金管理有限公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层
法定代表人:李勤
电话:(021)38969999
传真:(021)33627962
联系人:赵良
客户服务中心电话:40088-50099
(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:王利民
经办律师:秦悦民、王利民
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼
首席合伙人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:傅琛慧
经办会计师:汪棣、傅琛慧

六、基金的名称

本基金名称:华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

七、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

八、基金的投资目标

通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,并在谋求基金资产长期增值的基础上择机实现一定的收益和分配。

九、基金的投资方向

本基金以华安上证180ETF、上证180指数成份股、备选成份股为主要投资对象,其中投资于华安上证180ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;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%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股(首次发行或增发等)及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(包括但不限于指数衍生金融产品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

十、基金的投资策略

(一)投资策略
本基金为华安上证180ETF的联接基金,主要通过投资于华安上证180ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖华安上证180ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。本基金对标的指数的跟踪目标是:在正常情况下,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
1、资产配置策略
本基金将主要投资于华安上证180ETF、上证180指数成份股和备选成份股,其中华安上证180ETF投资比例不低于90%,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%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股(首次发行或增发等)及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。
本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。
2、基金投资策略
(1)基金组合的构建原则
本基金对基金的投资仅限于其指定的目标ETF,现时目标ETF仅指华安上证180ETF。
(2)基金组合的构建方法
①本基金可以以成份股实物形式申购及赎回华安上证180ETF基金份额;
②本基金可在二级市场上买卖华安上证180ETF基金份额,本基金的基金管理人在二级市场上买卖华安上证180ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。
(3)基金组合的调整
根据本基金的申购和赎回情况,结合基金的现金头寸管理,对基金投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。
3、股票投资策略
(1)股票组合的构建原则
根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,基金经理以抽样复制法构建组合。
(2)股票组合的构建方法
本基金以上证180指数成份股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造股票组合。如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素的限制,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对股票组合管理进行适当变通和调整,最终获得更接近标的指数的收益率。
(3)股票组合的调整
①定期调整
本基金股票组合根据所跟踪的上证180指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。
②不定期调整
基金经理将跟踪标的指数变动,基金组合跟踪偏离度情况,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。
针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购。
4、债券投资策略
本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。
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、短期金融工具等产品的比例,并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合,在一定的风险度下能提供最大的预期收益,或者在确定收益率上承担最小的风险。
5、其他金融工具投资策略
在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。本基金的基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,不得用于投机交易目的。
(二)投资限制
1、组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性