（上接B38版）

109)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/
110)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
111)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
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
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
112)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
电话:010-62020088
传真:010-62020088-8002
113)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11层
法定代表人:路瑶
电话:010-65807865
传真:010-65807868
客服电话:951624088888160
网址:www.cifcofund.com
114)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
115)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
办公地址: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/
116)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809
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
法定代表人:
公司网站:http://www.yixinfund.com
服务热线:400-6099-500
客服邮箱:service@yixinfund.com
117)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
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
118)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
119)深圳腾元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心406-407
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
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22楼
法定代表人:林利军
电话:(021)28932878
传真:(021)28932876
联系人:王小练

(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等),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、供应者的议价能力、行业内竞争者的竞争程度)对不同行业的影响,进一步精选阶段性重点配置的行业。
此外,本基金还密切关注国家经济政策的变化,分析政策变化后隐藏的驱动因素,寻找符合国家政策导向、高度受益于新政策的行业投资机会。
本基金在控制组合风险的前提下,灵活应用行业轮动策略。在宏观经济和市场环境发生变化时,本基金将对行业配置进行及时调整和动态优化。

3、个股精选策略
在行业配置的基础上,针对备选的上市公司,本基金从中挑选出具有投资价值的优质公司(主要特征包括:具有良好的公司治理结构、诚信优秀的公司管理层、独特的核心竞争优势),组成本基金的精选股票库。
在精选股票库的基础上,本基金继续从内在价值、相对价值以及收购价值等角度,考察备选公司的市盈增长比率(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,给出目标股票综合评级,从中选择市场估值相对较低、基本面良好或有良性变化、市场认同度逐步提高、能够为股东持续创造价值的公司,组成本基金的核心股票库。

4、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和跨品种套利策略来完成。

5、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。主要策略为低成本避险和合理杠杆操作。

(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)上市公司基本面及成长前景;
(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
本基金具体的投资决策机制与流程为:
(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。
(三)投资限制
1、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)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,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;
(5)向基金管理人、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债券;
(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)当时有效的法律法规、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。
2、投资组合限制
本基金的投资组合将遵循以下限制:
(1)持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
(3)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%;
(4)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;
(5)现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%;
(6)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%;
(7)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%;
(8)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%;
(9)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(10)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;
(11)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;
(12)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。
《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。
基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。
由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

九、基准指数与业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
本基金选择该业绩基准,是基于以下因素:
1、沪深300指数和上证国债指数合理、透明;
2、沪深300指数和上证国债指数的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指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数;
4、沪深300指数有一定市场覆盖率,并且不易被操纵;
5、基于本基金的股票、债券和现金比例,选用该业绩比较基准能够忠实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。

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风险较高预期收益的品种。

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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014年1月1日起至3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	534,523,743.79	89.07
	其中:股票	534,523,743.79	89.07
2	固定收益投资	20,020,000.00	3.34
	其中:债券	20,020,000.00	3.34
	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	18,503,798.76	3.08
7	其他资产	27,080,599.74	4.51
8	合计	600,128,142.29	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	-	-
C	制造业	429,713,136.47	71.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	35,005,321.30	5.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,856,000.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,815,491.33	4.32
J	金融业	6,054,000.00	1.01
K	房地产业	36,079,794.69	6.04
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	534,523,743.79	89.50

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	600352	浙江龙盛	2,859,389	46,493,665.14	7.78
2	000860	顺鑫农业	2,573,711	37,885,025.92	6.34
3	002019	鑫富药业	1,282,930	36,884,237.50	6.18
4	600517	置信电气	1,977,832	35,521,862.72	5.95
5	600535	天士力	771,895	30,096,186.05	5.04
6	600305	恒顺醋业	1,680,222	27,774,069.66	4.65
7	002249	大洋电机	1,999,912	26,698,825.20	4.47
8	600486	扬农化工	769,978	26,556,541.22	4.45
9	600998	九州通	1,390,000	22,240,000.00	3.72
10	000671	阳光城	1,999,991	18,899,914.95	3.16

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	20,020,000.00	3.35
	其中:政策性金融债	20,020,000.00	3.35
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	20,020,000.00	3.35

1.5 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	130248	13国开48	200,000	20,020,000.00	3.35

1.6 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
注: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序的前五名贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。
1.8 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 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。
1.9.2 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。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.10.1 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。
1.10.2 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。
1.10.3 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。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1
报告期内本基金投资的其他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。
1.11.2
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。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	406,956.03
2	应收证券清算款	26,205,672.64
3	应收股利	-
4	应收利息	369,946.36
5	应收申购款	98,024.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,080,599.74

1.11.4 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处于转股期的可转换债券。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

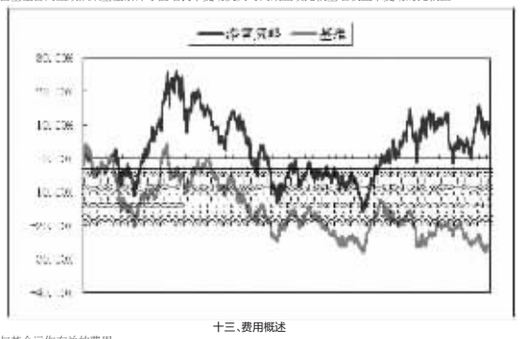
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002019	鑫富药业	36,884,237.50	6.18	重大资产重组停牌
2	600998	九州通	22,240,000.00	3.72	重大事项停牌

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)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)
2009年12月22日(基金合同生效日)至2009年12月31日	1.40%	0.15%	4.19%	1.35%	-2.79%	-1.20%
2010年1月1日至2010年12月31日	21.60%	1.22%	-9.37%	1.26%	30.97%	-0.04%
2011年1月1日至2011年12月31日	-26.37%	1.14%	-19.20%	1.04%	-7.17%	0.10%
2012年1月1日至2012年12月31日	3.81%	1.08%	6.71%	1.02%	-2.90%	0.06%
2013年1月1日至2013年12月31日	10.69%	1.30%	-5.57%	1.11%	16.26%	0.19%
2014年1月1日至2014年3月31日	2.95%	1.42%	-6.16%	0.95%	9.11%	0.47%
2009年12月22日(基金合同生效日)至2014年3月31日	7.39%	1.19%	-26.51%	1.11%	33.90%	0.08%

(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、费用概述

(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。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.50%÷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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%÷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。
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。
(3)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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会有关规定不得列入基金费用的项目。
(4)费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金赎回费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率、基金赎回费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率、基金赎回费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。
(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”:
更新了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”:
更新了主要人员情况。
三、“四、 基金托管人”:
1、更新了主要人员情况。
2、更新了基金托管业务经营情况。
四、“五、 相关服务机构”:
更新了基金份额发售机构的相关信息。
五、“九、 基金的投资”:
更新了基金投资组合报告。
六、“十、 基金的业绩”:
更新了本基金业绩表现数据。
七、“二十二、其他应披露事项”:
更新2013年12月23日至2014年6月22日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司
2014年8月5日

(上接B37版)

合并资产负债表-续

单位:元

项目	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
流动负债:			
短期借款	12,253,172,686.28	11,153,474,075.90	7,123,871,585.56
交易性金融负债	300,000,000.00	-	1,358,530.00
应付票据	9,720,732,211.72	7,556,072,006.81	7,190,722,621.16
应付账款	23,910,585,781.98	16,179,430,739.68	13,722,356,474.91
预收款项	4,863,816,985.78	2,365,108,072.40	4,347,837,003.43
应付职工薪酬	542,457,409.25	449,762,312.32	319,165,188.63
应交税费	1,393,176,479.51	2,017,040,248.69	1,074,805,003.73
应付利息	84,613,869.59	106,239,181.05	49,242,315.48
应付股利(应付利润)	22,103,796.14	22,184,220.06	41,604,327.24
其他应付款	10,670,002,843.61	8,985,505,896.95	7,866,147,764.78
一年内到期的非流动负债	888,151,349.06	657,360,840.15	2,145,827,061.73
其他流动负债	51,368,445.89	1,328,886,741.87	28,914,236.43
流动负债合计	64,700,181,858.81	50,821,064,335.88	43,911,852,113.08
非流动负债:			
长期借款	1,105,083,000.00	1,052,100,000.00	1,073,000,000.00
应付债券	2,377,223,299.73	1,778,073,669.44	985,272,325.28
长期应付款	6,726,359.86	7,790,958.40	170,933,772.44
专项应付款	322,119,687.29	309,194,890.45	46,370,945.20
预计负债	770,119,283.27	408,910,692.36	282,757,056.94
递延所得税负债	160732951.40	115,901,187.40	-
其他非流动负债	1,345,019,934.51	2,107,552,210.43	1,396,019,562.53
流动负债合计	6,087,024,516.10	5,779,523,608.48	3,954,353,662.39
负债合计	70,787,206,374.91	56,600,587,944.36	47,866,205,775.47
所有者权益:			
实收资本	800,000,000.00	800,000,000.00	200,000,000.00
资本公积	4,013,690,386.04	4,077,524,044.76	2,943,176,697.53
未分配利润	-210,087,366.82	-520,507,421.75	-1,206,215,936.28
外币报表折算差额	-1,362,055.99	-	-
归属于母公司所有者权益	4,602,240,963.23	4,357,016,623.01	1,936,960,761.25
少数股东权益	17,555,839,553.07	13,123,109,227.84	8,607,244,022.58
所有者权益合计	22,158,080,516.30	17,480,125,850.85	10,544,204,783.83
负债和所有者权益总计	92,945,286,891.21	74,080,713,795.21	58,410,410,559.30

(二)合并利润表

单位:元

项目	2013年度	2012年度	2011年度
一、营业收入	93,893,328,040.24	76,601,467,778.92	55,468,905,003.97
减:营业成本	65,742,861,693.21	54,472,826,729.36	40,340,814,454.45
营业税金及附加	5,517,045,354.14	5,652,601,699.42	4,081,361,783.23
销售费用	8,064,482,112.63	6,344,767,833.58	4,747,998,889.90
管理费用	5,503,045,940.83	3,525,939,542.74	2,599,406,230.44
财务费用	1,652,006,425.08	1,971,216,543.33	105,732,450.51
资产减值损失	73,086,875.87	172,853,104.53	260,517,117.18
加:公允价值变动损益	-297,250.00	1,788,900.00	-1,526,400.00
投资收益	737,973,737.58	1,105,881,775.34	315,882,675.22
二、营业利润	8,078,476,126.06	5,568,933,001.30	3,647,430,353.48
加:营业外收入	473,473,850.20	524,448,900.17	821,697,132.55
减:营业外支出	62,271,977.01	51,567,839.27	37,038,019.92
三、利润总额	8,489,677,999.25	6,041,814,062.20	4,432,089,466.11
减:所得税费用	2,426,616,317.12	1,651,826,549.02	1,206,610,582.13
四、净利润	6,063,061,682.13	4,389,987,513.18	3,225,478,883.98
其中:归属于母公司所有者的净利润	451,625,017.57	703,676,617.29	226,370,053.43
少数股东损益	5,611,436,664.56	3,686,310,895.89	2,999,108,830.55

(三)合并现金流量表

单位:元

项目	2013年度	2012年度	2011年度
一、经营活动产生的现金流量:			
销售商品、提供劳务收到的现金	97,796,946,286.12	79,023,615,673.71	58,737,077,476.48
收到的税费返还	131,351,549.71	120,686,466.49	56,736,282.83
收到其他与经营活动有关的现金	221,319,367.38	3,042,586,765.39	3,645,779,401.35
经营活动现金流入小计	98,149,617,203.21	82,186,888,905.59	62,439,593,160.66
购买商品、接受劳务支付的现金	62,842,806,669.59	54,237,345,231.98	41,498,151,340.71
支付给职工以及为职工支付的现金	3,208,167,845.54	3,065,260,239.64	2,273,734,771.39
支付的各项税费	16,506,358,215.40	15,580,846,751.54	8,221,351,503.49
支付其他与经营活动有关的现金	7,889,058,653.33	7,095,505,794.86	6,498,890,248.46
经营活动现金流出小计	90,446,391,383.86	79,978,958,018.02	58,492,127,864.05
经营活动产生的现金流量净额	7,703,225,819.35	2,207,930,887.57	3,947,465,296.61
二、投资活动产生的现金流量:			
收回投资收到的现金	60,721,500.00	213,811,231.76	107,508,295.62
取得投资收益收到的现金	216,898,682.31	115,024,716.67	120,720,601.58
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	159,877,507.19	163,510,656.77	127,219,110.48
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	184,387,609.46	60,548,764.43	2,693,204.42
收到其他与投资活动有关的现金	282,260,656.20	1,938,992,604.97	970,514,615.60
投资活动现金流入小计	904,145,955.16	2,491,887,974.60	1,328,655,827.70
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	8,021,663,234.70	6,743,910,298.23	6,669,184,368.64
投资支付的现金	1,524,686,205.00	762,384,288.00	1,028,789,796.68
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额	19,862,035.55	111,526,776.31	30,308,606.13
支付其他与投资活动有关的现金	688,815,832.15	465,923,227.68	1,034,657,431.68
投资活动现金流出小计	10,255,027,307.40	8,083,744,590.22	8,762,940,203.13
投资活动产生的现金流量净额	-9,350,881,352.24	-5,591,856,615.62	-7,434,284,375.43
三、筹资活动产生的现金流量:			
吸收投资收到的现金	13,200,000.00	45,121,781.86	88,080,450.00
其中:子公司吸收少数股东投资收到的现金	13,200,000.00	17,950,000.00	63,349,450.00
取得借款收到的现金	17,280,824,673.38	13,480,972,294.70	8,657,482,991.35
收到其他与筹资活动有关的现金	9,878,789,340.84	12,865,510,051.93	7,642,730,341.15
筹资活动现金流入小计	27,172,814,014.22	26,391,