

**(上接B109版)**

5. 申购价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择适合的交易时机,增持相对低估、价格将上升的债券,减持相对高估、价格将下降的债券。

3. 可转换债券投资策略

可转债属于兼具股票和债券属性的公司(企业)债券,其投资人具有一定条件下转股和回售的权利,因此其理论价值应当等于其所含的纯债价值加上可转换公司债券内含期权价值,是一种兼具债性,又具有权益性的复合债券产品。

本基金可参与一级市场可转债申购的申购,在二级市场,本基金关注转债级性较强的可转债品种,超越级性较强的可转债品种,4. 回售保护策略

到期赎回条款是本基金重要的操作策略之一,在信用产品投资和回购交易结合起来,基金经理根据信用产品的特征,在信用风险和流动性风险可控的前提下,或者通过回购融资来赚取超额收益,或者通过回购的不断滚动来收取信用债收益率和资金成本的成本。

5. 投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例,组合准入原则,回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并调整具体的投资策略,向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员,负责执行投资指令,就指令执行过程中的问题及市场的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈,并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易限制。

6. 投资程序

投资决策委员会负责确定基金投资重大决策,基金经理在授权范围内,制定具体的投资组合方案并执行,集中交易室负责执行投资指令。

(1) 基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点,并结合本基金合同、投资风格和投资策略。

(2) 投资策略委员会投资决策委员会,投资决策委员会审批本基金的投资比例,大类资产配置比例,组合基准久期,回购比例等重要事项。

(3) 基金经理根据批准后的投资策略确定最终的投资分布比例,组合基准久期和个券投资分布方式等。

(4) 对已投资品种进行跟踪,对投资组合进行动态调整。

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	600219	南山铝业	2,105,263	22,778,945.66	0.84

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	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	140,072,264.00	5.16
	其中:政策性金融债	140,042,000.00	5.16
4	企业债	1,271,156,196.91	50.49
5	企业中期票据	311,644,000.00	11.86
6	中期票据	442,213,000.00	16.29
7	短期融资券	104,725,375.60	3.86
8	中小企业私募债	30,000,000.00	1.10
9	其他	-	-
10	合计	2,399,848,481.51	88.38

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	140210T	1,400,000	140,042,000.00	5.16
2	112190	11巨田02	1,100,000	113,784,000.00	4.19
3	04185808	14巨田001	1,000,000	100,700,000.00	3.71
4	121210	12巨田01	880,000	87,320,000.00	3.21
5	112020	12巨田01	758,800	76,179,074.40	2.81

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119027	华信05	410,000	38,586,644.44	1.42
2	119028	华信04	370,000	34,822,068.49	1.28
3	119025	华信03	340,000	31,996,657.53	1.18

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

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投资

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货持仓

(2) 本基金投资股指期货的投资策略

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

本基金本报告期末未持有国债期货持仓和损益明细

(2) 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持仓。

11. 投资组合报告附注

(1) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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。

(2) 申明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有前十名股票超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	287,581.70
2	应收国债款	29,891,167.25
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	57,813,516.75
6	其他应收款	846,548.28
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,538,831.98

(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	110028	国电转债	4,366,300.00	0.16
2	128007	通钢转债	1,378,862.40	0.05

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有流通受限的股票

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述事项

因组合五人原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项可能存在尾差。

**十二、基金业绩**

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。

1. 全国社保基金纯债债券型证券投资基金历史各时间阶段净值增长率与业绩比较基准收益率比较表



注:截止时间为2014年9月30日。  
本基金于2014年12月31日成立,本基金建仓在两个月,即以2014年12月31日起至2015年6月4日,建仓期末时各项资产配置比例符合基金合同约定的。

**十三、费用概览**

(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) 基金合同生效后的会计师费、律师费和诉讼费;

(5) 基金的持有人大会费用;

(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。

14. 与基金运作无关的费用

14.1 与基金运作无关的费用

14.2 与基金运作无关的费用

14.3 与基金运作无关的费用

14.4 与基金运作无关的费用

14.5 与基金运作无关的费用

14.6 与基金运作无关的费用

14.7 与基金运作无关的费用

14.8 与基金运作无关的费用

14.9 与基金运作无关的费用

14.10 与基金运作无关的费用

14.11 与基金运作无关的费用

14.12 与基金运作无关的费用

14.13 与基金运作无关的费用

14.14 与基金运作无关的费用

14.15 与基金运作无关的费用

14.16 与基金运作无关的费用

14.17 与基金运作无关的费用

14.18 与基金运作无关的费用

14.19 与基金运作无关的费用

14.20 与基金运作无关的费用

14.21 与基金运作无关的费用

14.22 与基金运作无关的费用

14.23 与基金运作无关的费用

14.24 与基金运作无关的费用

14.25 与基金运作无关的费用

14.26 与基金运作无关的费用

14.27 与基金运作无关的费用

14.28 与基金运作无关的费用

14.29 与基金运作无关的费用

14.30 与基金运作无关的费用

14.31 与基金运作无关的费用

14.32 与基金运作无关的费用

14.33 与基金运作无关的费用

14.34 与基金运作无关的费用

14.35 与基金运作无关的费用

14.36 与基金运作无关的费用

14.37 与基金运作无关的费用

14.38 与基金运作无关的费用

14.39 与基金运作无关的费用

14.40 与基金运作无关的费用

14.41 与基金运作无关的费用

14.42 与基金运作无关的费用

14.43 与基金运作无关的费用

14.44 与基金运作无关的费用

14.45 与基金运作无关的费用

14.46 与基金运作无关的费用

14.47 与基金运作无关的费用

14.48 与基金运作无关的费用

14.49 与基金运作无关的费用

14.50 与基金运作无关的费用

14.51 与基金运作无关的费用

14.52 与基金运作无关的费用

14.53 与基金运作无关的费用

14.54 与基金运作无关的费用

14.55 与基金运作无关的费用

14.56 与基金运作无关的费用

14.57 与基金运作无关的费用

14.58 与基金运作无关的费用

14.59 与基金运作无关的费用

14.60 与基金运作无关的费用

14.61 与基金运作无关的费用

14.62 与基金运作无关的费用

14.63 与基金运作无关的费用

14.64 与基金运作无关的费用

14.65 与基金运作无关的费用

14.66 与基金运作无关的费用

14.67 与基金运作无关的费用

14.68 与基金运作无关的费用

14.69 与基金运作无关的费用

14.70 与基金运作无关的费用

14.71 与基金运作无关的费用

14.72 与基金运作无关的费用

14.73 与基金运作无关的费用

14.74 与基金运作无关的费用

14.75 与基金运作无关的费用

14.76 与基金运作无关的费用

14.77 与基金运作无关的费用

14.78 与基金运作无关的费用

14.79 与基金运作无关的费用

14.80 与基金运作无关的费用

14.81 与基金运作无关的费用

14.82 与基金运作无关的费用

14.83 与基金运作无关的费用

14.84 与基金运作无关的费用

14.85 与基金运作无关的费用

14.86 与基金运作无关的费用

14.87 与基金运作无关的费用

14.88 与基金运作无关的费用

14.89 与基金运作无关的费用

14.90 与基金运作无关的费用

14.91 与基金运作无关的费用

14.92 与基金运作无关的费用

14.93 与基金运作无关的费用

14.94 与基金运作无关的费用

14.95 与基金运作无关的费用

14.96 与基金运作无关的费用

14.97 与基金运作无关的费用

14.98 与基金运作无关的费用

14.99 与基金运作无关的费用

14.100 与基金运作无关的费用

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=H×0.25%÷当年天数

H为前一日计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人每日计算,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下一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=H×0.25%÷当年天数

H为前一日计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人每日计算,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下一个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。

(3) 基金合同生效后的会计师费、律师费和诉讼费

(4) 基金合同生效后的持有人大会费用

(5) 基金的证券交易费用

(6) 基金的银行汇划费用

(7) 基金的持有人大会费用

(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。

14. 与基金运作无关的费用

14.1 与基金运作无关的费用

14.2 与基金运作无关的费用

14.3 与基金运作无关的费用

14.4 与基金运作无关的费用

14.5 与基金运作无关的费用

14.6 与基金运作无关的费用

14.7 与基金运作无关的费用

14.8 与基金运作无关的费用

14.9 与基金运作无关的费用

14.10 与基金运作无关的费用

14.11 与基金运作无关的费用

14.12 与基金运作无关的费用

14.13 与基金运作无关的费用

14.14 与基金运作无关的费用

14.15 与基金运作无关的费用

14.16 与基金运作无关的费用

14.17 与基金运作无关的费用

14.18 与基金运作无关的费用

14.19 与基金运作无关的费用

14.20 与基金运作无关的费用

14.21 与基金运作无关的费用

14.22 与基金运作无关的费用

14.23 与基金运作无关的费用

14.24 与基金运作无关的费用

14.25 与基金运作无关的费用

14.26 与基金运作无关的费用

14.27 与基金运作无关的费用

14.28 与基金运作无关的费用

14.29 与基金运作无关的费用

14.30 与基金运作无关的费用

14.31 与基金运作无关的费用

14.32 与基金运作无关的费用

14.33 与基金运作无关的费用

14.34 与基金运作无关的费用

14.35 与基金运作无关的费用

14.36 与基金运作无关的费用

14.37 与基金运作无关的费用

14.38 与基金运作无关的费用

14.39 与基金运作无关的费用

14.40 与基金运作无关的费用

14.41 与基金运作无关的费用

14.42 与基金运作无关的费用

14.43 与基金运作无关的费用

14.44 与基金运作无关的费用

14.45 与基金运作无关的费用

14.46 与基金运作无关的费用

14.47 与基金运作无关的费用

14.48 与基金运作无关的费用

14.49 与基金运作无关的费用

14.50 与基金运作无关的费用

14.51 与基金运作无关的费用

14.52 与基金运作无关的费用

14.53 与基金运作无关的费用

14.54 与基金运作无关的费用

14.55 与基金运作无关的费用

14.56 与基金运作无关的费用

14.57 与基金运作无关的费用

14.58 与基金运作无关的费用

14.59 与基金运作无关的费用

14.60 与基金运作无关的费用

14.61 与基金运作无关的费用

14.62 与基金运作无关的费用

14.63 与基金运作无关的费用

14.64 与基金运作无关的费用

14.65 与基金运作无关的费用

14.66 与基金运作无关的费用

14.67 与基金运作无关的费用

14.68 与基金运作无关的费用

14.69 与基金运作无关的费用

14.70 与基金运作无关的费用

14.71 与基金运作无关的费用

14.72 与基金运作无关的费用

14.73 与基金运作无关的费用

14.74 与基金运作无关的费用

14.75 与基金运作无关的费用

14.76 与基金运作无关的费用

14.77 与基金运作无关的费用

14.78 与基金运作无关的费用

14.79 与基金运作无关的费用

14.80 与基金运作无关的费用

14.81 与基金运作无关的费用

14.82 与基金运作无关的费用

14.83 与基金运作无关的费用

14.84 与基金运作无关的费用

14.85 与基金运作无关的费用

14.86 与基金运作无关的费用

14.87 与基金运作无关的费用

14.88 与基金运作无关的费用

14.89 与基金运作无关的费用

14.90 与基金运作无关的费用

14.91 与基金运作无关的费用

14.92 与基金运作无关的费用

14.93 与基金运作无关的费用

14.94 与基金运作无关的费用

14.95 与基金运作无关的费用

14.96 与基金运作无关的费用

14.97 与基金运作无关的费用

14.98 与基金运作无关的费用

14.99 与基金运作无关的费用

14.100 与基金运作无关的费用

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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,对基金招募说明书进行了更新,主要更新内容包括:

1、“重要提示”部分进行了更新,对招募说明书的截止日日期及有关财务数据的截止日更新;

2、“基金管理人”部分对基金管理人概况,主要人员情况,基金基本情况进行了更新;

3、“基金托管人”部分进行了更新;

4、“基金份额持有人”部分对基金份额持有人权利和义务进行了更新;

5、“基金的投资”部分对基金的投资目标、投资范围、投资策略、资产配置、业绩比较基准进行了更新;

6、“基金的费用”部分对基金的费用进行了更新;

7、“基金的业绩”部分对基金业绩更新至2015年3月31日,并更新了历史走势图对比图;

8、“二、其他应披露事项”部分对报告期内披露的基金相关事项进行了更新。

注:上述特定申购费率适用于通过本公司直销渠道,选择后端收费模式申购本基金基金份额的养老金客户,包括基本养老金客户和依法成立的养老专项筹集的资金及其投资收益归集形成的补充养老金等,具体包括:全国社会保障基金;可以投

## 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金调整所持全部停牌股票估值方法的公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定,汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)与基金托管人协商一致,决定自2015年7月8日起,对旗下基金(除ETF基金、QDII基金外)所持全部停牌股票采用“指数收益法”进行估值。对于今后新增的停牌股票及估值调整,本公司将另行公告。本公司将上述调整事项及时体现在场外交易市场交易确认后,将恢复采用当日收盘价进行估值,届时将不再另行公告。

投资者可以登录本公司网站:www.99fund.com,或拨打本公司客服热线:400-888-9918咨询相关情况。

特此公告。

## 汇添富基金管理股份有限公司关于通过网上直销申购旗下基金费率优惠的公告

为感谢广大投资者的信任与支持,汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)决定自2015年7月10日起,对投资者通过本公司网上直销系统(trade.99fund.com)或移动客户端“现金宝”APP申购(含定投及转换)本公司旗下基金开展0费率优惠活动。

一、优惠适用范围

2015年7月10日起,节假日期间另行公告。

二、适用范围

本次活动适用于本公司旗下所有处于正常申购期的开放式基金(仅限前端收费模式、场外模式),具体适用范围详见下表,活动期间符合上述条件的新增基金均可适用。

基金名称	基金代码
汇添富优势精选混合	510008
汇添富均衡增长混合	510018
汇添富成长先锋混合	510068
汇添富回报混合	A类:510078
汇添富定期纯债混合	510966
汇添富价值精选混合	510969
汇添富上证领先指数	470007
汇添富中证500指数	470008
汇添富中证500指数增强	470009
汇添富香港恒生红利精选(QDII)	470088
汇添富国际可转债	470066
汇添富社会责任混合	A类:470018
汇添富中证500指数增强	A类:470028
汇添富可转债债券	A类:470058
汇添富黄金及贵金属(400040-FOF)	164701
汇添富中证500ETF联接	470068
汇添富信用债债券	A类:470088
汇添富中证500ETF	470098
汇添富中证500ETF联接	164702
汇添富季季定期开放债券	A类:470010
汇添富多元收益债券	A类:470011
汇添富可转债债券	400080
汇添富中证500ETF	A类:000012
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富沪深300ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	000080
汇添富中证500ETF	000087
汇添富中证500ETF	A类:000022
汇添富中证500ETF	000013
汇添富中证500ETF	A类:000014
汇添富中证500ETF	A类:000021
汇添富中证500ETF	000068
汇添富安心可转债	A类:000095
汇添富双利增强债券	A类:000066
汇添富中证500ETF	A类:164704
汇添富中证500ETF	0000