（上接B85版）

客服电话：95162 4008888160
网址：www.xifcofund.com
137）浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼D区801室
办公地址：浙江杭州西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心D区801室
法定代表人：陆彬彬
联系人：邓秀芳
电话：0571-56028620
传真：0571-56899710
客户服务电话：400-068-0058
公司网站：http://www.jincheng-fund.com/
138）北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁霆
电话：010-66154828
传真：010-88067526
客服电话：010-88067525
网站：www.5irich.com
139）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/
140）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9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809
法定代表人：沈伟桦
公司网站：www.yixinfund.com
服务热线：400-6099-200
客服邮箱：service@yixinfund.com
141）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：王骥
电话：010-59393923
传真：010 -59393074
客服电话：400-808-0069
网址：www.wy-fund.com
142）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号建成大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建成大厦1208-1209室
法定代表人：罗细安
电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
联系人：乔晋峰
网址：www.zcvc.com.cn
客户服务电话：400-001-8811
143）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：4006 877 899
联系方式：0755-3337 6922
传真号码：0755-3306 5516
客服邮箱：service@tenyuanfund.com
144）深圳宜投基金销售有限公司
客户服务电话：4008-955-811
网址：www.yitfund.com
145）一路财富（北京）信息科技有限公司
客服电话：400-001-1566
网站：www.yilucaifu.com
146）海银财富管理有限公司
客服电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
147）北京恒天明泽投资顾问有限公司
客服电话：4006-525-676
网站：www.haofunds.com
148）上海联泰资产管理有限公司
客服电话：400-046-6788
网站：www.66zichan.com
149）上海汇付金融服务有限公司
客服电话：400-820-2819
网址：www.tty.com
150）上海陆金所资产管理有限公司
客服电话：4008219031
网站：www.lufunds.com
151）中信建投期货有限公司
注册地址：南中区中山三路107号上站大楼平面11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
办公地址：南中区中山三路107号上站大楼平面11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
邮编：400014
电话：023-86769605
网址：www.cfc108.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：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：010-58598835?
传真：010-58598907
联系人：任瑞昕
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海浦东世纪大道1256号华夏银行大厦14层
负责人：廖海
经办律师：廖海、田卫红
电话：021-51150298
传真：021-51150398
联系人：廖海
（四）审计基金财产的会计师事务所
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
公司电话：010-58153000
公司传真：010-85188298
签章会计师：蔺育化、汤筱
业务联系人：汤筱

第四部分、基金的名称

本基金名称：汇添富成长焦点混合型证券投资基金。

第五部分、基金的类型

第六部分、基金的投资目标

本基金为契约型开放式混合型基金。

本基金是主动混合型基金，精选成长性较高，且估值有吸引力的股票进行布局，在有效管理风险的前提下，追求中长期较高的投资回报。

第七部分、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、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构公后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

四类资产配置的比例范围：股票60-95%、债券投资产支持证券0-35%、权证0-3%、现金类资产最低为5%。

基金资产类别配置范围

资产类别	选择的资产	配置下限	配置上限
股票	A股	60%	95%
债券及资产支持证券	国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、资产支持证券等	0%	35%
权证	权证	0%	3%
现金类资产	现金、到期日在一年以内的政府债券	5%	-

本基金股票部分至少80%投资于成长性较高，且估值有吸引力的股票，该部分股票预期未来两年EPS增长率应超过本基金成长股票池的平均水平。

今后在有关法律法规许可时，本基金资产配置比例可作相应调整，股票资产投资比例可达到法律法规有关规定的限额。

第八部分、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中，通过资产战略配置和战术配置来确定每一阶段投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例；在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出成长性较高，且估值有吸引力的股票，精心构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。

一、资产配置策略

本基金将通过资产战略配置和战术配置来确定每一阶段投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例。

1、资产战略配置策略

在资产战略配置中，本基金策略分析师根据当前宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况等因素，结合市场估值、对股票、债券和现金类资产的风险和收益进行预测，并根据上述指标进行情景分析，提出对各类别资产的年度配置建议，由基金经理向投资决策委员会提交以形成决议。

关于当前宏观经济环境和经济增长前景，本基金主要考察宏观经济趋势变化、宏观经济增长模式以及宏观经济政策的变化及含义。关于证券市场环境，本基金主要考察制度性建设和变革、证券市场政策变化、参与主体变化、上市公司数量、质量和市场估值变化。

2、资产战术配置策略

在资产战术配置中，本基金策略分析师根据市场估值和市场情绪，分析下一阶段（比如一个季度）的市场走势，提出对各类别资产的配置建议，由基金经理向投资决策委员会提交下一阶段的各类别资产配置计划；投资决策委员会召开会议，讨论并确定下一阶段的各类别资产的具体配置比例，由基金经理执行。

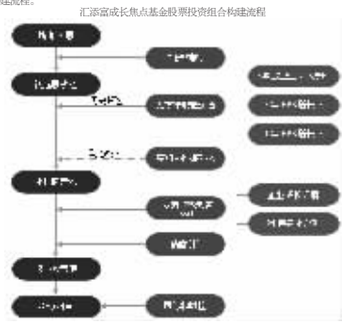
二、股票投资策略

本基金致力投资于成长性较高，且估值有吸引力的股票进行布局。该部分股票预期未来两年EPS增长率应超过本基金成长股票池的平均水平。

为达精选之目的，本基金管理人结合定量分析和定性分析，构建三级过滤模型（Tri-Filtering Model）来动态建立和维护核心股票池，从成长性的质量和成长速度两个角度来深入挖掘企业成长，从而精选出成长性较高，且估值有吸引力的股票进行投资布局，同时将风险管理意识贯穿于股票投资过程中，对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。

下图是本基金股票组合构建流程。

汇添富成长焦点基金股票投资组合构建流程



1、初选股票池构建

本基金首先对A股市场中的所有股票进行初选剔除，以过滤掉明显不具备投资价值的股票，建立初选股票池，从而缩小研究范围，提高工作效率。剔除的股票包括法律法规和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。

2、成长股票池构建

在初选股票池的基础上，本基金结合定量分析和定性分析，以历史指标定量筛选为主，以突发性成长股动态纳入为辅，筛选出具有成长潜力的个股，构建成长股票池。

（1）定量筛选，纳入具有良好历史成长性的股票

本基金基于上市公司年报数据，运用基金管理人研究确定的成长股定量筛选标准，筛选出具有良好历史成长性的股票，将其纳入成长股票池，作为成长股票池的主体部分。

本基金历史成长股定量筛选标准选取历史3年每股主营业务收入增长率、历史3年EPS增长率和历史1年EPS增长率为量化指标，并按上述指标对初选股票池分别进行排序，使进入成长股票池的股票同时满足以下三个条件：

①位于按历史3年每股主营业务收入增长率由高到低排序的初选股票池的前1/2；

②位于按历史3年EPS增长率由高到低排序的初选股票池的前1/2；

③位于按历史1年EPS增长率由高到低排序的初选股票池的前1/2。

（2）动态纳入，补充加入突发性成长的股票

突发性成长指，虽然没有表现出良好的历史成长性，但由于基本面状况出现较大的转变，预期企业业绩会出现突发性增长，包括以下几种情形：

①由于国内外社会、经济、政治环境出现重大变化，企业业绩出现突发性增长，例如，SARS和禽流感等流行性疾病的爆发可能会导致有关疫苗生产企业业绩突发性增长；

②从行业的周期性低谷开始复苏，而出现突发性增长；

③由于地区或产业扶持政策，企业业绩出现突发性增长；

④由于并购、重组、资产注入等因素，企业业绩出现突发性增长；

⑤由于某种关键性技术的重大突破，企业业绩出现突发性增长。

⑥由于其它基本面因素的重大变化，企业业绩出现突发性增长。

行业研究员通过持续的跟踪研究，发掘出具有上述突发性成长特征的股票，动态纳入成长股票池，作为成长股票池的补充部分。

（3）成长股票池调整

对于成长股票池中的历史成长股部分，在每年上市公司年报披露后，本基金将根据历史成长股定量筛选标准进行调整。

对于成长股票池中的突发性成长股部分，本基金将根据引致企业突发性成长的因素的变化进行动态调整。

3、核心股票池构建

本基金对成长股票池中的股票进行扎实的案头研究和实地调研，精选出预期未来两年EPS增长率高于成长股票池平均水平，且估值有吸引力的股票，构建核心股票池。

（1）考察企业成长质量

本基金从企业成长外部环境和企业成长内部因素两个角度考察企业成长质量：

①企业成长外部环境

■法律环境：包括权益保护、商业规范以及市场制度等，良好的法律环境将为企业成长提供有力的法律支持和保障。

■政策环境：严格的市场准入政策、扶持性的地区和产业政策、优惠的税费政策以及宽松的信用政策等将有利于企业的成长。

■市场环境：合理的行业集中度、有利的竞争态势以及不断增长的市场需求等将为企业成长提供所必需的市场空间。

■资源环境：良好的资源环境将在生产资料来源以及发展资金筹措等方面等促进企业的可持续成长。

②企业成长内部因素

■制度因素：完善的内部治理结构及规范的管理制度是企业稳定持续成长的制度保证；

■管理团队因素：团结高效、且富有进取精神的管理团队是企业不断成长的驱动力；

■生产和销售因素：企业在资源配置、产能扩张、销售网络以及市场知名度和品牌效应等方面的独特优势可以推动企业不断提高市场占有率，保持主营业务收入的持续增长；

■技术因素：较强且具有持续性的技术研发能力和学习能力，可以使企业所掌握的技术不断地转化为新产品或新服务，从而为企业成长提供源源不断的动力；

■财务状况因素：良好的企业财务状况、合理的资本结构，较强的偿付能力以及突出的成本控制能力是企业持续成长的物质基础。

（2）预测未来两年EPS增长率

在预测企业未来两年EPS增长率时，本基金将从以下几点着手分析：

①考察企业的历史EPS增长率，历史财务指标具有客观、定量的优点，尤其当公司基本面相对稳定时，历史外推法具有良好的预期效果；

②考察市场供求变动趋势，主要分析企业产品的生命周期，在产品的引进和成长期，需求量大且竞争者少，产品供不应求为企业主营业务的快速增长奠定了基础，在这种市场供求趋势下，预期企业将会有较高的EPS增长率；

③考察替代品的影响，分析企业产品与替代品之间的差异度，如果差异性大，较难替代，则EPS增长率预期会有较好的保障；

④考察产量的增加或服务的提升，产量和服务的扩张是企业实现业务收入增长的主要方式，将为EPS的持续增长奠定基础；

⑤考察企业成本，成本因素是EPS预测的重要方面，本基金将分析原材料价格、财务费用以及管理费用等成本因素的变化，并考察企业利润对成本的敏感性。

（3）估值分析

基于企业的成长质量和预期未来两年EPS增长率，本基金采用量化的PEG指标来评估企业的投资价值：

$$PEG = \frac{4/EPS}{g}$$

其中：P为计算日股票的收盘价；

EPS为当年预期每股收益；

为预期两年EPS增长率的平均值

根据企业和行业的不同特点，可以选择更适合的指标进行估值，这些指标包括但不限于市盈率（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。

4、构建投资组合

基金经理根据本基金的投资决策程序，审慎精选，权衡风险收益特征后，构建投资组合并动态调整。

5、持续跟踪和风险控制

对所投资的企业进行密切跟踪，保持精密的风险意识，关注发展变化，动态评估企业价值，同时由金融工程小组通过流动性测试、压力测试、情景分析和VaR分析等技术对投资组合进行动态风险评估。

三、债券投资策略

本基金将通过资产配置将一部分基金资产投资于债券，包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、企业债和可转债等。此外，市场未来推出的各类固定收益证券及其衍生品也可能成为本基金的投资对象。

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。

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。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。

四、权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的；在个证层面上，充分发掘可能的套利机会，以达到增值的目的。

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证，并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

其他权证类资产的投资遵从法律法规或监管部门的相关规定。

（二）投资决策依据和决策程序

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，会议讨论确定行业评级。

（2）基金经理在策略会议的基础上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）投资研究部提交成长股票池，在此基础上，基金经理、行业研究员决定核心股票池名单。

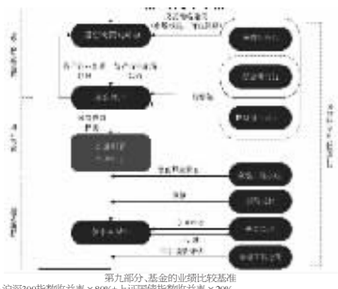
（5）基金经理在考虑资产配置的情况下，经过风险收益的权衡，决定投资组合方案。

（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。

投资决策机制与流程



第九部分、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

选择该业绩基准，是基于以下因素：

（1）沪深300指数和上证国债指数合理、透明；

（2）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）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。

基金管理人在两种情况下可以修改业绩比较基准：一是在基金合同修改的前提下，基金管理人可根据投资目标和投资政策的变更，确定新的业绩比较基准，并及时公告；二是当市场出现更合适、更权威的比较基准时，本基金管理人有权选用新的比较基准，并及时公告。

第十部分、基金的风险收益特征

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

第十一部分、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2016年1月19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。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

投资组合报告

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	4,455,529,022.21	89.24
	其中：股票	4,455,529,022.21	89.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,310,000.00	3.01
	其中：债券	150,310,000.00	3.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	379,448,322.02	7.60
8	其他资产	7,360,605.59	0.15
9	合计	4,992,647,949.82	100.00

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	106,083,688.64	2.13
C	制造业	2,166,473,041.10	43.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	95,100,386.74	1.91
F	批发和零售业	553,417,956.48	11.13
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	480,001,912.53	9.66
J	金融业	579,977,375.84	11.67
K	房地产业	123,555,973.60	2.49
L	租赁和商务服务业	172,725,000.00	3.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	161,360,000.00	3.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,833,767.28	0.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,455,529,022.21	89.63

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	600180	瑞茂通	16,187,906	357,428,964.48	7.19
2	002127	新民科技	13,290,505	248,798,253.60	5.01
3	002018	华信国际	7,500,000	229,650,000.00	4.62
4	601166	兴业银行	11,000,000	187,770,000.00	3.78
5	300285	国瓷材料	4,101,782	186,631,081.00	3.75
6	600585	海螺水泥	10,750,000	183,825,000.00	3.70
7	002589	瑞康医药	5,000,000	179,550,000.00	3.61
8	002183	怡亚通	3,750,000	172,725,000.00	3.47
9	002672	东江环保	8,000,000	161,360,000.00	3.25
10	300050	世纪瑞利	4,200,035	150,781,256.56	3.03

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	150,310,000.00	3.02
	其中：政策性金融债	150,310,000.00	3.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	150,310,000.00	3.02

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	150211	15国开11	1,000,000	100,290,000.00	2.02
2	130202	13国开02	500,000	50,020,000.00	1.01

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。

1.1 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：本基金本报告期期末未持有贵金属投资。

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。

1.2 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.2.1 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。

1.2.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.2.3 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

1.2.4 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。

1.2.5 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

投资组合报告附注

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。

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。

其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,949,381.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,022,859.17
5	应收申购款	1,388,365.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,360,605.59

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。

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	002018	华信国际	229,650,000.00	4.62	重大事项停牌

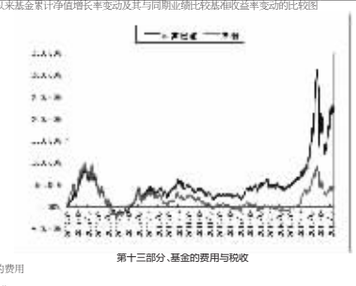
第十二部分 基金的业绩

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（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)
2007年3月12日（基金合同生效日）至2007年12月31日	75.34%	1.68%	83.35%	1.75%	-8.01%	-0.07%
2008年1月1日至2008年12月31日	-50.85%	1.83%	-50.88%	2.41%	0.03%	-0.58%
2009年1月1日至2009年12月31日	63.79%	1.72%	77.54%	1.62%	-13.75%	0.10%
2010年1月1日至2010年12月31日	7.51%	1.36%	-9.37%	1.26%	16.88%	0.10%
2011年1月1日至2011年12月31日	-21.53%	0.99%	-19.20%	1.04%	-2.33%	-0.05%
2012年1月7日至2012年12月31日	4.77%	0.89%	6.71%	1.02%	-1.94%	-0.13%
2013年1月1日至2013年12月31日	17.00%	1.24%	-5.57%	1.11%	22.57%	0.13%
2014年1月1日至2014年12月31日	19.10%	1.10%	42.21%	0.97%	-23.11%	0.13%
2015年1月1日至2015年12月31日	84.39%	2.87%	5.68%	1.99%	78.71%	0.88%
2007年3月12日（基金合同生效日）至2015年12月31日	220.58%	1.63%	41.92%	1.54%	178.66%	0.09%

（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



第十三部分、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）销售服务费；

（4）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

（5）基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

（6）基金份额持有人大会费用；

（7）基金的证券交易费用；

（8）银行汇划费用；

（9）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《基金合同》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1.5%年费率计提，管理费的计算方法如下：

H=E×1.5%÷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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，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2.5%。的年费率计提，托管费的计算方法如下：

H=E×2.5%÷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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前2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、公休日等，支付日期顺延。

（3）销售服务费

销售服务费是指基金管理人根据基金合同的约定及届时有效的相关法律法规的规定，从开放式基金财产中计提的一定比例的费用，用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

基金管理人可以选取适当的时机（但应于中国证监会发布有关收取开放式证券投资基金销售费用的规定后）开始计提销售服务费，但至少应提前2个工作日在至少一种指定报刊和网站上公告，公告中应规定计提销售服务费的条件、程序、用途和费率标准。

基金管理人依据本基金合同及届时有效的有关法律法规公告收取基金销售服务费或酌情降低基金销售服务费的，无须召开基金份额持有人大会。

上述一、基金费用的种类中第4—9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的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或基金托管费率等相关费率，调低基金管理费率或基金托管费率，由基金管理人和基金托管人协商一致，经中国证监会核准后公告，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，调高基金管理费率、基金托管费率等相关费率须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告并报中国证监会备案。

5、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。

（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。

第十四部分、对招募说明书更新部分的说明

一、“重要提示”部分：

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。

二、“三、基金管理人”部分：

更新了基金管理人的相关信息。

三、“四、基金托管人”部分：

更新了基金托管人的相关信息。

四、“五、相关服务机构”部分：

更新了基金相关服务机构的信息。

五、“九、基金的投资”部分：

更新了基金投资组合报告。

六、“十、基金业绩”部分：

更新了基金业绩表现数据。

七、“二十二、其他应披露事项”部分：

更新了2015年9月13日至2016年3月12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
2016年4月20日

泰达宏利基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持，经与浙江同花顺基金销售有限公司（以下简称“同花顺”）协商一致，泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定旗下指定基金自2016年4月22日起参加同花顺的费率优惠活动。现将具体费率优惠情况公告如下：

一、适用基金

编号	基金代码	基金名称
1	162201	泰达宏利价值优化型成长类行业混合型证券投资基金
2	162202	泰达宏利价值优化型周期类行业混合型证券投资基金
3	162203	泰达宏利价值优化型稳定类行业混合型证券投资基金
4	162204	泰达宏利于业精选混合型证券投资基金
5	162205	泰达宏利风险预算混合型证券投资基金
6	162207	泰达宏利收益性债券混合型证券投资基金（LOF）
7	162208	泰达宏利首选企业股票型证券投资基金
8	162209	泰达宏利市值优选混合型证券投资基金
9	162210	泰达宏利集利债券型证券投资基金A类
10	162211	泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金
11	162212	泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金
12	162213	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金
13	162214	泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金
14	002470	泰达宏利多元回报债券型证券投资基金A类
15	162216	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
16	229002	泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金
17	000026	泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金A类
18	000169	泰达宏利收益增强债券型证券投资基金A类
19	000388	泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金B类
20	000507	泰达宏利养老收益混合型证券投资基金A类
21	000319	泰达宏利集利债券型证券投资基金A类
22	000828	泰达宏利特型机遇股票型证券投资基金
23	001017	泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金
24	001170	泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金
25	001254	泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金A类
26	001267	泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金
27	001419	泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金A类
28	001418	泰达宏利益民灵活配置混合型证券投资基金A类
29	001141	泰达宏利益民灵活配置混合型证券投资基金A类
30	001896	泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金
31	002263	泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金

二、活动时间

费率优惠活动自2016年4月22日起开展，优惠活动期限以同花顺活动公告为准。敬请投资者留意同花顺的有关公告。

三、活动内容

投资者通过同花顺申购上述适用基金，前端申购费实行1折优惠，原前端申购费为固定金额的，则按原费率规定执行，不再享有费率优惠。具体各基金原申购费率参见该基金最新更新的招募说明书及相关公告。

四、重要提示

1.投资者在同花顺办理上述适用基金相关业务，具体办理规则及程序应遵循同花顺的规定。

2、投资者应认真阅读拟投资基金的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，了解所投资基金的风险收益特征，并根据自身情况购买与本人风险承受能力相匹配的产品。

3.本优惠活动仅适用于本公司通过同花顺在处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费，不包括基金赎回、转换业务等其他业务的手续费。

五、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

1.浙江同花顺基金销售有限公司

客户服务电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

2.泰达宏利基金管理有限公司

客户服务电话：400-698-8888

网址：www.mfcteda.com

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本公司旗下基金前应认真阅读各基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

?

泰达宏利基金管理有限公司
2015年4月20日

泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2016年4月20日

1公告基本信息

基金名称	泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利大数据混合
基金主代码	002263
基金运作方式	契约型开放式，混合型证券投资基金
基金合同生效日	2016年2月23日
基金管理人名称	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	泰达宏利基金管理有限公司
公告依据	《泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下