（上接B73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
129）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
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
130）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：上海市浦东新路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
电 话：021-58870011
传 真：021-68596919
公司网站：http://www.howbuy.com/
131）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：0571-26008533
客服电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/
132）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：单丙烨
电话：021-20691832
传真：021-20691861
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com
133）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
邮 编：310012
联系人：胡翌
联系电话：0571-88911818
传 真：0571-86800423
客服电话：4008-773-772
公司网址：www.5ifund.com
134）北京展恒基金销售股份有限公司
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
135）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
136）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：95162 4008888160
网址：www.cifcofund.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4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：邓秀男
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）北京益金益投资管理有限公司
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：梁容
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：王堑
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：罗灿安
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
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@teenyunfund.com
144）深圳宜投基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号深港合作区管理局综合办公楼A栋201
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人：华德强
电话：0755-88607645
传真：0755-88603185
145）一路财富（北京）信息科技有限公司
名 称：一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
邮政编码：100033
注册资本：5000万元人民币
法定代表人：吴雪秀
电 话：010-88312877
传 真：010-88312099
146）海银基金销售有限公司
网址：www.fundhaiyin.com
客服电话：400-808-1016
147）中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人：徐福星
电话：010-68998820-8188
传真：010-88381550
148）北京君德汇富投资咨询有限公司
北京君德汇富投资咨询有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人：李振
电话：65181028
传真：65174782
149）北京恒久添信投资咨询有限公司
北京恒久添信投资咨询有限公司
客服电话：4006-525-676
网站：www.haofund.com
150）上海联泰资产管理有限公司
名 称：上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
邮政编码：200335
注册资本：2000万人民币
法定代表人：燕斌
电 话：021-51507071
传 真：021-62990063
151）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
客服电话：4006411999
网站：www.taichengcaifu.com
152）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
邮政编码：200010
注册资本：2000万人民币
法定代表人：陈怡青
联系人：张裕
电话：021-60897840
传真：0571-26008533
客服电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/
132）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：单丙烨
电话：021-20691832
传真：021—20691861
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com
133）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
邮 编：310012
联系人：胡翌
联系电话：0571-88911818
传 真：0571-86800423
客服电话：4008-773-772
公司网址：www.5ifund.com
134）北京展恒基金销售股份有限公司
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
135）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
136）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：95162 4008888160
网址：www.cifcofund.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4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：邓秀男
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）北京益金益投资管理有限公司
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：梁容
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：王堑
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：罗灿安
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
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@teenyunfund.com
144）深圳宜投基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号深港合作区管理局综合办公楼A栋201
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人：华德强
电话：0755-88607645
传真：0755-88603185
145）一路财富（北京）信息科技有限公司
名 称：一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
邮政编码：100033
注册资本：5000万元人民币
法定代表人：吴雪秀
电 话：010-88312877
传 真：010-88312099
146）海银基金销售有限公司
网址：www.fundhaiyin.com
客服电话：400-808-1016
147）中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人：徐福星
电话：010-68998820-8188
（2）违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
（5）向其基金管理人、基金托管人出资；
（6）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；
（7）法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的，如适用于本基金，则本基金不受上述相关限制。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深300安中动态策略指数收益率×95%＋金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能考市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并在指定媒体公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在指定媒体上公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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2015年10月23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7月1日起至9月30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	233,798,583.01	91.01
	其中：股票	233,798,583.01	91.01
2	固定收益投资	255,501.42	0.10
	其中：债券	255,501.42	0.10
	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	19,754,919.40	7.69
7	其他资产	3,088,616.43	1.20
8	合计	256,897,620.26	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末指数投资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	1,062,273.77	0.42
B	采矿业	20,020,598.16	7.99
C	制造业	104,372,460.48	41.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,114,284.58	8.82
E	建筑业	4,555,363.13	1.82
F	批发和零售业	7,846,279.62	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,000,915.19	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,921,024.08	7.15
J	金融业	40,390,025.49	16.11
K	房地产业	5,165,119.70	2.06
L	租赁和商务服务业	2,285,553.06	0.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	950,478.25	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	490,969.32	0.20
R	文化、体育和娱乐业	2,397,107.38	0.96
S	综合	226,130.80	0.09
	合计	233,798,583.01	93.27

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注：本基金本报告期末未进行积极投资。
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
1.3.1 报告期末指数投资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	600519	贵州茅台	41,306	7,860,944.86	3.14
2	600887	伊利股份	503,460	7,743,214.80	3.09
3	600050	中国联通	1,270,768	7,637,315.68	3.05
4	000063	中兴通讯	355,256	5,541,993.60	2.21
5	601318	中国平安	152,024	4,539,436.64	1.81
6	600036	招商银行	234,689	4,170,423.53	1.66
7	600900	长江电力	371,062	3,558,484.58	1.42
8	600016	民生银行	417,713	3,529,674.85	1.41
9	600518	康美药业	255,699	3,457,050.48	1.38
10	002465	海格通信	234,248	2,991,346.96	1.19

1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
注：本基金本报告期末未进行积极投资。
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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	255,501.42	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	255,501.42	0.10

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	110031	航信转债	1,540	196,550.20	0.08
2	128009	歌尔转债	456	58,951.22	0.02

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
注：报告期末本基金无股指期货持仓。
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
注：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	141,364.40
2	应收证券清算款	2,786,153.35
3	应收股利	-
4	应收利息	4,363.28
5	应收申购款	156,735.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,088,616.43

1.11.4 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	128009	歌尔转债	58,951.22	0.02

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
1.11.5.1 报告期末指数投资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	600900	长江电力	3,558,484.58	1.42	重大资产重组停牌

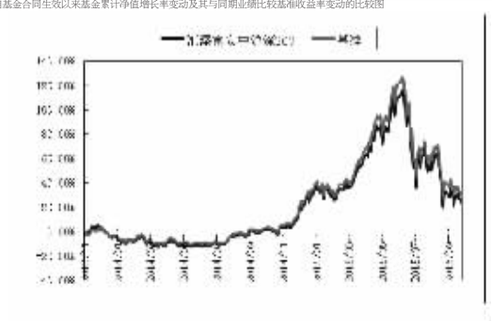
1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末未进行积极投资。

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)
2013年11月6日（基金合同生效日）至2013年12月31日	-4.02%	1.01%	-3.14%	1.13%	-0.88%	-0.12%
2014年1月1日至2014年12月31日	37.53%	1.09%	39.84%	1.10%	-2.31%	-0.01%
2015年1月1日至2015年9月30日	-5.74%	2.86%	-4.05%	2.70%	-1.69%	0.16%
2013年11月6日（基金合同生效日）至2015年9月30日	24.42%	1.97%	29.83%	1.89%	-5.41%	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、基金的费用与税收

一、与基金运作有关的费用
（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、标的指数使用许可费；
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、律师费和诉讼费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
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。
（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0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.5%÷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5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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.1%÷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5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，支付日顺延。
3、标的指数使用许可费
基金的标的指数使用许可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×标的指数使用许可费年费率÷当年天数，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数使用许可费年费率为0.02%。
H为每日应计提的基金标的指数使用许可费
E为前一日基金资产净值
标的指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，于每年1月、4月、7月、10月的前十个工作日内按照指定的账户路径将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日，支付日顺延。
标的指数使用许可费的收取下限为每季度人民币5000元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。若当季已计提的标的指数使用许可费累计未达到该计费期间的收取下限，则在当季末一次性补提差额部分。
基金管理人可根据指数许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。
标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒体上刊登公告。
本基金转换为“汇添富沪深300安中动态策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金”后，本基金不再收取指数使用许可费，基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费、托管费。
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。
（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。
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部分“基金份额的申购与赎回”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部分“基金份额的申购与赎回”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部分“基金份额的申购与赎回”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：
1、更新了基金管理人的法定代表人、联系人。
2、更新了董事会、监事会及高管人员的情况。
3、更新了基金经理的信息。
4、更新了投资决策委员会的人员。
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：
1、修改了基金的风险收益特征。
2、更新了基金投资组合报告。
六、“十二、基金的业绩”部分：
更新了基金业绩数据。
七、“二十二、其他应披露事项”部分：
更新了2015年3月7日至2015年11月6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
2015年12月16日

（上接B74版）

151）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
泰诚财富基金销售（大连）有限公司
客服电话：4006411999
网站：www.taichengcaifu.com
152）上海汇付金融服务有限公司
名 称：上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
邮政编码：200010
注册资本：2000万人民币
法定代表人：张晶
电 话：021-33323998
传 真：021-33323993
153）北京乐融多源投资咨询有限公司
名 称：北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
邮政编码：100022
注册资本：2000万元人民币
法定代表人：董浩
电 话：010-56409010
154）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
组织形式：有限责任公司
存续期间：持续经营
联系人：宁博宇
电 话：021-20665952
传 真：021-22066653
155）珠海盈米财富管理有限公司
名 称：珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203
邮政编码：510308
注册资本：2432.4311万元人民币
法定代表人：肖雯
电 话：020-89629021
传 真：020-89629011
156）中信建投期货有限公司
注册地址：渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
办公地址：渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
邮编：400014
电话：023-86769605
网址：www.cfc108.com
157）中信期货有限公司
客服电话：400-990-8826
网站：www.citicsf.com
158）徽商期货有限责任公司
客服电话：4008878707
网站：www.hsqh.net
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：李文
电话：（021）28932888
传真：（021）28932998
联系人：韩从慧
（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：黎明、孙睿
联系人：孙睿
（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：阚育化、汤骏
业务联系人：汤骏

四、基金的名称

本基金名称：汇添富沪深300安中动态策略指数型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深300安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。

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，以沪深300安中动态策略指数的成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可介入提供予银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
如法律法规或监管机构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。
基金的投资组合比例为：本基金投资于沪深300安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略
本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照成份股在沪深300安中动态策略指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。沪深300安中动态策略指数的提供者将每月更新指数组合的成分股以及相关权重并通知本基金管理人，本基金管理人将做出对应的调整以便匹配目标指数的配置。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
本基金投资于沪深300安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的90%，其余资产可投资于银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。
本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。
在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。
（二）投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制：
（1）本基金投资于沪深300安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的90%；
（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）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
（4）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%；
（5）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%；
（6）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%；
（7）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%；
（8）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%；
（9）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%；
（10）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)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；
（11）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；
（12）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%；
（13）本基金持有的流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的2%；经基金管理人和基金托管人协商，履行适当程序后可对以上比例进行调整；
（15）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；
（16）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
（17）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；
（18）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；
（19）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；
（20）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；
（21）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的10%。
（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。
因证券期货市场波动、证券发行人合并、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。
法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：
中证主要消费行业指数 × 40% ＋ 中证可选消费行业指数 × 40% ＋ 上