（上接B78版）

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/
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:胡巍
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:邓秀男
电话:0571-56028620
传真:0571-56899710
客户服务电话:400-068-0058
公司网站:http://www.jinchengg-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:梁静
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:王敏
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:罗仙安
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@tenyuanfund.com
144) 深圳前海长城基金销售有限公司
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:华建强
电话:0755-88607645
传真:0755-88603185
145) 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.fundhaiyan.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) 北京恒久浩信投资咨询有限公司
北京恒久浩信投资咨询有限公司
客服电话:4006-525-676
网站:www.haofunx.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
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:上海市静安区天目西路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:张益
电 话:021-33323998
传 真:021-33323993
153) 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
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:肖雳
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
3.场外代销机构
爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、財富证券、財富里昂、財通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、商华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华龙证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、开源证券、万联证券、五矿证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)
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
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
联系人:严峰、朱立元
电话:0755-25946013,010-59378839
传真:010-59378907
(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:邵红、黎明
联系人:邵红
(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
签署会计师:徐慧、阚肯化
业务联系人:徐艳

四、基金的名称

本基金名称:汇添富互利分级债券型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理,力争实现资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为固定收益类品种,国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款及协议存款),以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证,也不参与一级市场新股申购,因持有可转债转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。
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:本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

(一)投资策略
本基金将密切关注债券市场的运行状况及风险收益特征,分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,自上而下决定类属资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。
1、类属资产配置策略
不同类属的券种,由于受到不同的因素影响,在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各券种的利差变化趋势,综合分析政策法率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素,合理配置并动态调整不同类属债券的投资比例。
2、普通债券投资策略
(1)利率策略
本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构,结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判,从而预测社会融市场利率水平变动趋势,在此基础上,结合期限利差与气候等综合分析,制定出具体的利率策略。
具体而言,本基金将首先采用“自上而下”的研究方法,综合研究主要经济变量指标,分析宏观经济状况,建立经济前景的宏观景模拟,进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势与结构,对影响资金面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模拟。
在此基础上,本基金将结合历史与经验数据,区分当前利率债收益率曲线的期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,判断收益率曲线参数变动的概率与幅度,即可能收益率曲线平移的方向、陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析,以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时,即市场利率将上升,本基金将降低组合久期以规避损失;如出现负向平移的概率较大时,则提高组合久期;如收益率曲线过于陡峭时,则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上,利用蝶形策略获取超额收益。
(2)信用策略
本基金依据内部信用评级系统跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估,以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险,我们设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”—“公司风险”(公司背景+公司行业地位+企业盈利模式+公司治理结构和信息披露状况+企业财务状况)—“外部支持”(外部流动性支持能力+债券担保增信)—“得到评分”的评级过程,其中,定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析,定量分析主要包括四个方面:盈利能力分析、偿债能力分析、现金流状况能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究,它是对定量分析的重要补充,能够有效提高定量分析的准确性。本基金内部的信用评级体系定位为短期评级,侧重于评级的准确性,从而为信用产品的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪,并快速做出反应,以便及时有效地抓住信用利差变化带来的市场交易机会。
(3)个券选择策略
本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究流程,自上而下的研究包含宏观基本面分析、资金技术面分析,自下而上的研究包含信用利差分析、债券信用风险评估、信用债估值模型和交易策略分析,由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系,最后形成具体的投资策略。
3、可转债投资策略
基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境情况等,本基金在一、二级市场投资可转换债券,以达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产稳健增值的目的。
1)行业配置策略
本基金将根据宏观经济走势、经济周期,以及阶段性市场投资主题的变化,综合考虑宏观调控目标、产业结构调整等因素,精选成长前景明确或受益政策扶持的行业内公司发行的可转换债券进行投资布局。另外,由于宏观经济所处的时期和市场发展的阶段不同,不同行业的可转换债券也将表现出不同的风险收益特征。在经济复苏的初期,持有资源类行业的可转换债券将获得良好的投资收益;而在经济衰退时期,持有防御类主周期行业的可转换债券,将获得更稳定的收益。
2)个券选择策略
本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略,在严格控制风险的前提上,精选具有投资价值的可转换债券券,力争实现较高的投资收益。
3)条款博弈策略
本基金将深入分析公司基本面,包括经营状况和财务状况,预测其未来发展战略和融资需求,结合流动性、到期收益率、纯债溢价率等因素,充分发掘这些条款给可转换债券带来的投资机会。
4)转股策略
在转股期内,当本基金所持有可转换债券市场交易价格显著低于转股平价时,即转股溢价率明显为负时,本基金将通过转股并在其上市交易后10个工作内卖出股票以实现收益。
4、中小企业私募债券投资策略
本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。
本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行分类,以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。
本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主,所投资的中小企业私募债券的剩余期限不超过基金的剩余封闭运作期。在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。
基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
(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债券市场的影响;
(3)国家货币政策及债券市场政策;
(4)商业银行的信贷扩张;
(5)债券市场的基本情况。
2.投资决策程序
本基金投资决策流程为:
(1)宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向,提交策略报告。
(2)债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告。
(3)信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。
(4)数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。
(5)在分析研究报告的基础上,基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。
(6)投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。
(7)如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。
(8)集中交易室执行交易指令。
(三)投资限制
1.组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%;
(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)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(4)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%;
(5)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%;
(6)本基金持有的全部中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产的20%;本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;
(7)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%;
(8)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%;
(9)本基金持有的同一信用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%;
(10)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%;
(11)本基金应投资于信用级别评级为A以上(含A)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;
(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)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本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)从事无担无限责任的投资;
(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。
法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的,则本基金不受上述相关限制。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。
中债综合指数是中国全市场债券指数,以2001年12月31日为基期,基点为100点,并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,选择中债综合指数作为本基金固定收益类资产投资比较基准的依据的主要理由是:第一,该指数由中央国债登记结算公司编制,并在中国债券网(www.chinabond.com.cn)公开发布,具有较强的权威性和市场影响力;第二,该指数的样本券涵盖面广,能较好地反映债券市场的整体状况。
如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、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,或者基市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,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,而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
从投资者具体持有的基金份额来看,由于基金收益分配的安排,基金分级运作期内,互利A份额将表现出低风险、低收益的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额;互利B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和风险要高于普通的债券型基金份额。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	556,091,944.14	94.39
	其中:债券	551,091,944.14	93.54
	资产支持证券	5,000,000.00	0.85
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	18,299,098.72	3.11
7	其他资产	14,729,577.26	2.50
8	合计	589,120,620.12	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未投资股票。
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
注:本基金本报告期末未投资股票。
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	52,020,000.00	15.38
	其中:政策性金融债	52,020,000.00	15.38
4	企业债券	488,879,944.14	144.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,201,000.00	3.02
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	551,091,944.14	162.93

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	150210	15国开10	500,000	52,020,000.00	15.38
2	112059	11联化债	238,059	26,315,041.86	7.78
3	124915	14宏图02	200,000	22,470,000.00	6.64
4	124884	14双水02	200,000	21,950,000.00	6.49
5	124426	13澄池城	200,000	21,338,000.00	6.31

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

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	119110	14折盛02	50,000	5,000,000.00	1.48

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。
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投资。
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: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
报告期末本基金无国债期货持仓。
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	13,002.70
2	应收证券清算款	2,004,497.81
3	应收股利	-
4	应收利息	12,712,076.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,729,577.26

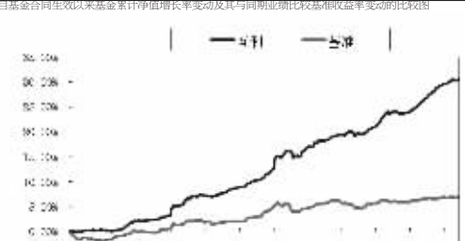
1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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	0.40%	0.11%	-1.85%	0.11%	2.25%	0.00%
2014年1月1日至2014年12月31日	15.98%	0.17%	6.54%	0.11%	9.44%	0.06%
2015年1月1日至2015年9月30日	12.15%	0.11%	2.34%	0.08%	9.81%	0.03%
2013年11月6日(基金合同生效日)至2015年9月30日	30.60%	0.15%	7.02%	0.10%	23.58%	0.05%

(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、基金销售服务费;
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、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、基金上市费用;
10、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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.70%÷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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.20%÷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、基金销售服务费
本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.50%÷当年天数
H为每日应计提的销售服务费
E为前一日基金资产净值
销售服务费每日计提,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出,分别支付给各基金销售机构,若遇法定节假日,公休日等,支付日期顺延。
销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。
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因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十章“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十章“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。
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、“十、基金的申购与赎回”部分:
增加了基金份额开放第四次申购与赎回的时间。
六、“十一、基金的投资”部分:
更新了基金投资组合报告。
七、“十二、基金的业绩”部分:
更新了基金业绩表现数据。
八、“二十五、其他应披露事项”部分:
更新了2015年5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

长盛基金管理有限公司关于增加平安银行为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告

一、根据长盛基金管理有限公司(以下简称"本公司")与平安银行股份有限公司(以下简称"平安银行")签署的证券投资基金销售代理协议,自2015年12月16日起,平安银行将代理长盛电子信息主题灵活配置型证券投资基金(以下简称"本基金",基金代码为000063)的销售业务。
二、自2015年12月16日起,投资者可在平安银行的各指定网点进行本基金的开户、申购、赎回、定期定额投资等业务。
三、开通定投业务
1、自2015年12月16日起开通平安银行对于本基金的定投业务;
2、定投业务细则详见平安银行的有关定投业务实施细则;
3、投资者可到平安银行申请开办定投业务并约定每期固定的投资金额,该投资金额即为申购金额,每期申购金额不低于人民币100元(含申购手续费),且不设金额级差。本业务不受日常申购最低数额限制。
四、开通转换业务
(一)转换费率
1、基金转换是指投资者将其持有的本公司管理的某开放式基金的全部或部分基金份额,转换为同为本公司管理的,且属同一注册登记机构的其他开放式基金的份额的一种业务模式。
2、本基金转换业务适用于与本公司所管理的以下基金间的转换:
长盛成长价值证券投资基金(基金代码:080001)
长盛同禧信用增利债券型证券投资基金(A类基金代码:080009,C类基金代码:080010)
长盛电子信息产业混合型证券投资基金(基金代码:080012)
长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:001239)
3、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购补差费两部分构成。
(1)转出基金赎回费按转出基金正常赎回时的赎回费率收取,转换申购补差费按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取。
(2)前端收费模式下,在转入基金申购费率高于转出基金申购费率时,基金转换申购补差费率为转入基金与转出基金的申购费率之差;在转入基金申购费率等于或小于转出基金申购费率时,基金转换申购补差费率为零。以外扣法计费;后端收费模式下,在转出基金申购费率高于转入基金申购费率时,基金转换申购补差费率为零。在转出基金申购费率低于转入基金申购费率时,基金转换申购补差费率为转出基金与转入基金的申购费率之差;在转出基金申购费率等于或小于转入基金申购费率时,基金转换申购补差费率为零。以内扣法计费。
(3)转换费用由投资者承担,其中赎回费用不低于25%的部分计入转出基金的基金资产。计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行。
4、基金转换金额、份额及费用计算公式
转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值
转出基金赎回手续费=转出金额×转出基金赎回手续费率
转换金额=转出金额-转出基金赎回手续费
前端收费基金补差费=转换金额×补差费率/(1+补差费率)
后端收费基金补差费=转换金额×补差费率
转入金额=转换金额-补差费
转入份额=转入金额/转入基金当日基金份额净值
5、转换金额、份额及费用计算过程
第一步:计算转出金额
转出金额 = 转出份额×转出基金当日基金份额净值
第二步:计算转换金额
转换金额=转出金额-转出基金赎回费
转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率
第三步:计算转入金额
转入金额=转换金额-补差费
补差费用:
前端收费基金补差费=转换金额×补差费率/(1+补差费率)
后端收费基金补差费=转换金额×补差费率
第四步:计算转入份额
转入份额= 转入金额÷转入基金转入申请当日基金份额净值
例如:某基金份额持有人持有10000 份长盛成长价值证券投资基金(080001),一年内决定转换为长盛电子信息产业混合型证券投资基金份额(080012),假设转换当日转出基金份额净值是1.0760元,转入基金的份额净值是1.0135元,对应赎回费率为0.5%,申购补差费率为0,则可得到的转换份额为:
转出金额=10000×1.0760=10760元
转出基金赎回手续费=10760×0.5%=53.80元
转换金额=10760-53.8=10706.2元
前端收费基金转换补差费率=0
前端收费基金补差费=10706.20×0/(1+0)=0元
转入金额=10706.2-0=10706.2元
转入份额=10706.2/1.0135=10563.59份
即:某基金份额持有人持有10000 份长盛成长价值证券投资基金一年内决定转换为长盛电子信息产业混合型证券投资基金,假设转换当日转出基金份额净值是10706.2元,转入基金的基金份额净值是1.0135