（上接B82版）

电 话:021-54509998
传 真:021-64385308
129）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:上海市浦东南路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/
130）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/
131）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
132）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:胡瑞
联系电话:0571-88911818
传 真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
133）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
134）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
135）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
136）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.jincheng-fund.com/
137）北京创金白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:梁睿
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客服电话:010-88067525
网站:www.5irich.com
138）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/
139）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
140）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:王斐
电话:010-59393923
传真:010 -59393074
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
141）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
142）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
143）深圳证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:华建强
电话:0755-88607645
传真:0755-88603185
144）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
145）海银基金销售有限公司
网址:www.fundhaiyin.com
客服电话:400-808-1016
146）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
147）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:李毅
电话:65181028
传真:65174782
148）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.haofunds.com
149）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
150）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
151）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
152）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
153）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
154）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
155）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
156）中信期货有限公司
中信期货有限公司
客服电话:400-990-8826
网站:www.citicsf.com
157）徽商期货有限责任公司
徽商期货有限责任公司
客服电话:4008878707
网站:www.hsqh.net
O类基金份额的端外销售机构情况,具体请参见招募说明书补充文件。
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
1、A类基金份额注册登记机构
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21楼
法定代表人:李文
电话:021 28932888
传真:021 28932998
联系人:韩从慧
2、O类基金份额注册登记机构
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:任瑞新
(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:吕红、黎明
联系人:吕红
(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:阚育化、汤骏
业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富汇营活力混合型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为契约型开放式混合型基金。

六、基金的投资目标

本基金采用目下而上的方法,精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局,在科学严格管理风险的前提下,力求基金资产的中长期增值。

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,基金持有金源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%。

本基金以民营企业上市公司为股票主要投资对象,投资于民营企业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%。本基金主要依据上市公司招股说明书、定期报告和股权变动公告判断该上市公司是否为民营企业上市公司,判断的主要标准为上市公司实际控制人。实际控制人是实际控制上市公司的自然人、法人或其他组织,具体而言,只要拥有下列情形之一的,即视为拥有上市公司控制权:投资者为上市公司持股50%以上的控股股东;投资者可以行使表决权比例超过30%;投资者通过实际支配上市公司股份表决权能够决定公司董事会半数以上成员选任;投资者依其可实际支配的上市公司股份表决权足以对公司股东大会的决议产生重大影响;中国证监会认定的其他情形。

本基金将实际控制人为境内自然人(不包括港澳台)控股的上市公司定义为民营企业上市公司。本基金拟投资的民营企业上市公司股票包括符合本基金定义的中证民营企业综合指数成份股、新股、发生股权变动后的已上市公司。

当市场出现符合本基金定义的更合适、更权威的表征民营企业上市公司的指数或中证民营企业综合指数停止发布时,基金管理人有权选用新指数的成份股或按本基金有关民营企业上市公司的定义自行选择股票来替换中证民营企业综合指数的成份股,并及时公告。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金为混合型基金,股票投资的主要策略包括资产配置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,个股精选策略用于挖掘成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。本基金通过投资于具有良好的公司治理结构、灵活的用人和分配机制、独特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业,以分享优秀民营企业成长所带来的资本增值。

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(如: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PE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,并在严格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、个股精选策略

首先,按照本基金投资范围的界定,针对沪深两市民营企业上市公司,根据本基金管理人投资管理制度要求以及股票投资限制,进行初步筛选,组成本基金的初选股票库。

其次,本基金采取定性分析的方法,对初选股票库中的上市公司进行深入分析和调查研究,评估公司的行业特征、经营状况、财务数据、业绩驱动因素、用人和分配机制等,给出股票综合评级,从中挑选出拥有良好的公司治理结构以确保股东利益与公司管理层利益的一致和在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等一个或数个方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的核心竞争优势的公司,组成本基金的精选股票库。

然后,本基金采取定量分析的方法,采用PEG指标来评估企业的投资价值(即企业未来盈余继续成长的可能性越高、幅度越大,投资者可接受的市盈率PE也越高;在PEG>0的情况下,PEG数值越小表明企业的估值越有吸引力),从精选股票库中选择成长性较高、估值有吸引力的公司,组成本基金的核心股票库。

3、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的较大规模、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。

4、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、指数与量化分析师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稽核监察部进行全程风险评估和绩效分析。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:

中证民营企业综合指数 × 80% + 上证国债指数 × 20%

选择该业绩基准,是基于以下因素:

1、中证民营企业综合指数和上证国债指数权威性、透明;
2、中证民营企业综合指数和上证国债指数有较高的知名度和市场影响力;
3、中证民营企业综合指数由中证指数有限公司编制,成份股包括沪深两市全部民营上市公司,可以全面反映沪深两市民营上市公司股票的整体表现;
4、中证民营企业综合指数有一定市场覆盖率,不易被操纵;
5、基于本基金的投资范围和投资比例限制,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,本基金管理人在履行适当程序后,可以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。

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	4,768,096,171.14	80.62
	其中:股票	4,768,096,171.14	80.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,116,597,366.91	18.88
8	其他资产	29,275,614.32	0.50
9	合计	5,913,969,152.37	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	1,539,782,838.09	26.13
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	645,132,197.89	10.95
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	1,083,058,814.90	18.38
J	金融业	218,400,000.00	3.71
K	房地产业	128,177,345.16	2.18
L	租赁和商务服务业	433,900,000.00	7.36
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	171,246,927.72	2.91
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	548,398,047.38	9.31
S	综合	-	-
	合计	4,768,096,171.14	80.93

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	002183	怡亚通	10,000,000	433,900,000.00	7.36
2	300144	宋城演艺	17,032,911	384,603,130.38	6.53
3	300166	东方国信	9,600,000	282,720,000.00	4.80
4	002018	华信国际	12,000,000	259,680,000.00	4.41
5	600172	黄河旋风	17,500,188	254,102,729.76	4.31
6	600180	瑞茂通	12,400,193	253,335,942.99	4.30
7	300359	全通教育	2,800,000	219,464,000.00	3.72
8	601166	兴业银行	15,000,000	218,400,000.00	3.71
9	601933	永辉超市	21,000,246	213,152,496.90	3.62
10	002095	生意宝	5,200,092	203,843,606.40	3.46

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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
注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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
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:本基金本报告期内未投资国债期货。
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	2,794,772.60
2	应收证券清算款	9,873,867.21
3	应收股利	-
4	应收利息	200,038.70
5	应收申购款	16,406,935.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,275,614.32

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	002183	怡亚通	433,900,000.00	7.36	重大事项停牌
2	002018	华信国际	259,680,000.00	4.41	重大事项停牌

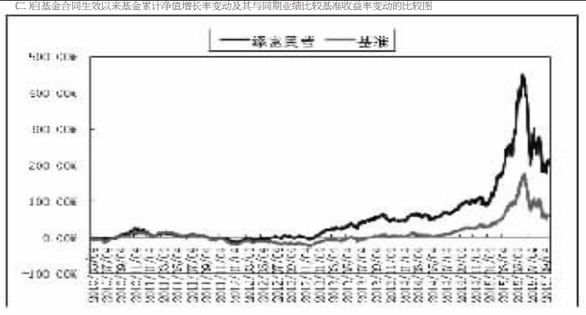
十二、基金的业绩

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)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)
2010年5月5日(基金合同生效日)至2010年12月31日	15.00%	1.28%	11.92%	1.45%	3.08%	-0.17%
2011年1月1日至2011年12月31日	-20.78%	1.00%	-23.95%	1.15%	3.17%	-0.15%
2012年1月1日至2012年12月31日	17.45%	1.06%	2.09%	1.18%	15.36%	-0.12%
2013年1月1日至2013年12月31日	38.17%	1.39%	22.50%	1.16%	15.67%	0.23%
2014年1月1日至2014年12月31日	27.94%	1.39%	24.33%	0.97%	3.61%	0.42%
2015年1月1日至2015年9月30日	63.43%	3.20%	23.76%	2.23%	39.67%	0.97%
2010年5月5日(基金合同生效日)至2015年9月30日	209.13%	1.65%	60.92%	1.37%	148.21%	0.28%

(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)基金费用的种类

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0.25%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。

上述“①-③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、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率,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。

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。

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。
四、“四、基金托管人”部分:
更新了基金托管人的相关信息。
五、“五、相关服务机构”部分:
更新了基金相关服务机构的信息。
六、“八、基金的申购和赎回”部分:
增加了基金O类份额的申购与赎回。
七、“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。
八、“十三、基金的收益分配”部分:
增加了基金O类份额的收益分配原则。
九、“十四、基金的费用与税收”部分:
增加了基金O类份额的基金税收义务。
十、“十六、基金的信息披露”部分:
增加了基金O类份额的信息披露。
十一、“十、基金的业绩”部分:
更新了基金业绩数据。
十二、“十二、其他应披露事项”部分:
更新了2015年5月6日至2015年11月5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B83版）

传真:021—20691861
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com
108）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:胡瑞
联系电话:0571-88911818
传 真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
109）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
110）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
111）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
112）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:梁睿
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客服电话:010-88067525
网站:www.5irich.com
113）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/
114）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:王斐
电话:010-59393923
传真:010 -59393074
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
115）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
116）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
117）中信期货有限公司
中信期货有限公司
客服电话:400-990-8826
网站:www.citicsf.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21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:吕红、黎明
联系人:吕红
(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:阚育化、汤骏
业务联系人:汤骏
四、基金的名称
本基金名称:汇添富理财30天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

本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。

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。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。

1、利率策略

本基金采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券组合,并管理组合风险。

首先通过全面分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求,判断宏观经济与流动性状况及其变化趋势,进而对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向进行研判,从而判断金融市场利率水平变动趋势。在此基础上,结合期限利差与凸度的综合分析,确定投资组合的久期配置,制定出具体的投资策略。

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、分析宏观经济情况,建立经济前景的情景模拟,进而判断财政政策、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,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。

在宏观分析与流动性分析的基础上,结合历史与经验数据,确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素,得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,判断收益率曲线参数变动的程度和概率,确定组合的平均剩余期限,并根据此动态调整投资组合。

2、信用策略

本基金依靠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