（上接B67版）

邮 编:310012
联系人:胡晓
联系电话:0571-88911818
传 真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
132）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
133）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
134）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.cn
135）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/
136）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：吴君
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客服电话:010-88067525
网站:www.5irich.com
137）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/
138）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
139）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门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门3201单元
法定代表人:王堤
电话:010-59393023
传真:010 -59393074
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com
140）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:乔晋峰
网址:www.zcvc.com.cn
客户服务电话:400-001-8811
141）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
142）深圳前海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
143）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
144）海银基金销售有限公司
网址:www.fundhaiyin.com
客服电话:400-808-1016
145）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:010-68998829-8188
传真:010-88381550
146）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
147）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
148）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:021-62900063
149）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
150）上海江付金融服务有限公司
名 称:上海江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:张品
电 话:021-33323998
传 真:021-33323993
151）上海凯石财富基金销售有限公司
上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
电话:021-63333389
传真:021-63333390
152）北京录融多源投资咨询有限公司
名 称:北京华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）大泰金石投资管理有限公司
大泰金石投资管理有限公司
客服电话:400928226
网站：www.dtfunds.com
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:肖雪
电 话:020-89629021
传 真:020-89629011
156）中信建投期货有限公司
注册地址:渝中区中山二路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C
办公地址:渝中区中山二路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
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
徽商期货有限责任公司
客服电话:4008878707
网站:www.hsqh.net
3.场内代销机构
指具有基金代销资格的深圳证券交易所场内会员单位,包括爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、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、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、华宝证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华鑫证券、华泰联合、华泰证券、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、天风证券、天源证券、万和证券、开源证券、万联证券、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
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:韩俊
电话:（021）31358666
传真:（021）31358600
经办律师:吕红、安冬
联系人:安冬
（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:吴港日
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:阚育化

四、基金的名称

本基金名称:汇添富季季红定期开放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

本基金主要投资于债券类固定收益品种,在严格管理投资风险的基础上,追求资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规获中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括中小企业私募债券、公司债、企业债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、国债、金融债、债券回购、央行票据、银行存款（同业存款、银行通知存款等）以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可投资于一级市场新股申购、股票增发以及可转债转股所得的股票或权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但不可直接从二级市场上买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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:在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%（但在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制）;权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金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%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略
1.资产配置策略
本基金80%以上的基金资产投资于债券资产,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机,力争为基金资产获取稳健回报。

类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类别债券利差水平研究,判断不同类别债券类属的相对投资价值,并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。

2.债券投资策略
本基金将无风险利率策略、信用策略和个券选择策略,判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值,并确定不同债券在组合资产中的配置比例,实现组合的稳健增值。

（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,结合期限利差与信度综合分析,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,建立经济前景的场景模拟,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,判断收益率曲线类数变动的程度与概率,即对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,本基金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,主要包括四个方面:盈利能力分析、偿债能力分析、现金流状况和营运能力分析。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即期评级,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,以便及时有效地抵住信用利差变化带来的市场交易机会。

除了跟踪债券目身的信用变化以外,本基金还会定期研究各评级、各期限信用利差的变化趋势,分析它们的相对投资价值,确定各类债券的投资比例。

（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。

本基金管理人将依据市场情况动态调整投资组合久期,坚持组合久期和封闭期适当匹配的原则。

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
可转换债券有别于一般债券,其自身含有的期权价值与公司股票价格走势、波动率水平等密切相关。本基金将采用“自上而下”的分析方法,综合考虑各种宏观因素,以实现最优的行业配置。

（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,精选个券,力争实现较高的投资收益。

（3）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卖出股票以实现收益;当可转换债券流动性不能满足组合需求时,本基金将通过转股来保障基金财产的流动性;当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时,本基金将首先通过转股来锁定已有收益,并进一步分析正股未来的价格走势,做出继续持有正股或立即卖出的决定。本基金通过可转债转股获得的股票持有期限不超过3个月。

（4）条款博弈策略
国内可转换债券一般设置提前赎回、向下修正转股价、提前回售等条款,其中赎回条款赋予发行人提前赎回可转换债券的权力,修正条款赋予发行人向下修正转股价格的权力,回售条款赋予投资者将可转换债券回售给发行人的权利,这些条款将对可转换债的价值产生影响。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。

（5）套利策略
本基金将密切关注以下套利机会:在可转换债券的转股期内,当转换溢价率为负时,可以买入可转换债券并及时转股,然后在二级市场卖出股票,以获取套利收益。

4.新股申购策略
在国内股票市场上,股票供求关系不平衡经常使得新股上市后的二级市场价格高于其发行价,从而使得新股（IPO和增发等）申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,最终制定相应的新股申购策略。本基金通过参与新股认购所获得的股票,在可上市交易后6个月内会部卖出。

5.权证投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,不主动进行权证投资,只在进行可分离债券投资时,被动参与权证投资。本基金通过可分离债券获得的权证持有期限不超过1个月。

未来,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

6.其他衍生工具投资策略
本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,一旦有新的产品推出市场,将在届时相应法律法规的框架内,制订符合本基金投资目标的投资策略,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用其他衍生金融工具进行套利、避险交易,控制基金组合风险,并通过灵活运用趋势投资策略获取超额收益。

7.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、合理逢病地评估、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）企业信用评级;
（4）国家货币政策及债券市场政策;
（5）商业银行的信贷扩张。
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,专门设立投资研究部,并设置策略分析师,固定收益分析师、金融工程小组和基金经理等岗位,充分发挥个人主观能动性以及团队合作精神,在投资研究的关键环节中,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）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
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
（1）本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
（2）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%;
（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%;
（6）在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%（在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制）;权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金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%;
（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（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%;
（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;
（12）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;
（13）本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
（14）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40%;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%;本基金投资中小企业私募债券的剩余期限不得超过每一封闭期的剩余封闭运作期。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、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。

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。
（9）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、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:银行三年期定期存款税后利率+1%。
本基金选择三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准的原因如下:
本基金以努力追求绝对收益为目标,以银行三年期定期存款税后利率+1%作为本基金的业绩比较基准,能比较贴切体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。
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指数时,本基金管理人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,但不需要召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国建设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

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	777,352,462.66	93.19
	其中:债券	777,352,462.66	93.19
	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	13,251,312.36	1.59
8	其他资产	43,514,112.88	5.22
9	合计	834,117,887.90	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持有股票。
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持有股票。
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	94,504,000.00	21.28
	其中:政策性金融债	94,504,000.00	21.28
4	企业债券	682,848,462.66	153.74
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	777,352,462.66	175.02

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	150218	15国开18	700,000	73,514,000.00	16.55
2	122835	11兴沪债	257,550	28,278,990.00	6.37
3	122395	15富力债	250,000	25,622,500.00	5.77
4	122494	15华夏05	250,000	25,250,000.00	5.69
5	136078	15禹洲01	250,000	24,991,616.44	5.63

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国债期货交易情况说明
1.9.1 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。
1.9.2 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。
1.9.3 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。
1.10 投资组合报告附注
1.10.1
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。
1.10.2
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。
1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	37,228.21
2	应收证券清算款	33,484,925.22
3	应收股利	-
4	应收利息	9,991,959.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,514,112.88

1.10.4 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。
1.10.5 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股票。

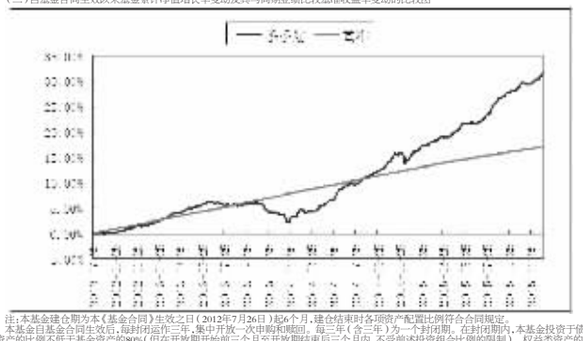
十二、基金的业绩

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。

（本基金业绩数据为截至2015年6月30日的数据）。
（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)
2012年7月26日（基金合同生效日）至2012年12月31日	1.90%	0.06%	2.28%	0.01%	-0.38%	0.05%
2013年1月1日至2013年12月31日	1.79%	0.10%	5.13%	0.02%	-3.34%	0.08%
2014年1月1日至2014年12月31日	11.84%	0.14%	5.22%	0.02%	6.62%	0.12%
2015年1月1日至2015年12月31日	13.59%	0.09%	4.37%	0.01%	9.22%	0.08%
2012年7月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日	31.77%	0.11%	17.12%	0.02%	14.65%	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



注:本基金建仓期为本（基金合同）生效之日（2012年7月26日）起6个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同规定。

本基金自基金合同生效后,每封闭运作二年,集中开放一次申购和赎回。每三年（含三年）为一个封闭期。在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%（但在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制）,权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金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%。

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.基金上市初费及上市月费;
4.基金财产拨付给交易所的银行费用;
5.基金合同生效后的基金信息披露费用;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
8.基金的证券交易费用;
9.基金的开户费用、账户维护费用
10.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
11.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
（三）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
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,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、休息日,支付日顺延。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,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、休息日,支付日顺延。
3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
（四）不列入基金费用的项目
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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。
（六）基金税收
基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。
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九章“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九章“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”:
更新了基金管理人的相关信息。
三、“四、基金托管人”:
更新了基金托管人的相关信息。
四、“五、相关服务机构”:
更新了相关服务机构的相关信息。
五、“十、基金的投资”部分:
更新了基金投资组合报告。
六、“十一、基金的业绩”部分:
更新了基金业绩表现数据。
七、“十三、其他应披露事项”部分:
更新了2015年7月27日至2016年1月26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3月5日

大成核心双动力混合型证券投资基金增聘基金经理的公告

公告送出日期:2016年3月5日

1 公告基本信息

基金名称	大成核心双动力混合型证券投资基金
基金简称	大成核心双动力混合
基金主代码	090011
基金管理人名称	大成基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	增聘基金经理
新任基金经理姓名	苏秉毅
共同管理本基金的其他基金经理姓名	张钟玉、石国武

2 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	苏秉毅
任职日期	2016年3月4日
证券从业年限	12年
证券投资管理从业年限	12年
过往从业经历	经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日至2015年8月25日兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金