（上接B035版）

新兰德网站:http://www.new-rand.cn/
94)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客服电话:400-920-0022
联系人:周轶
电话:021-20835789
传真:021-20835885
网址:licaike.hexun.com
95)厦门市鑫鼎盛证券投资咨询服务有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人:林松
联系人:高雪
电话:0592-3122719
传真:0592-8060771
客户服务电话:400-6980-777
网址:www.dkhs.com
96)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38600735
传真:021-38509777
97)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元
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
98)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
99)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/
100)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/
101)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
102)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:胡璇
联系电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
103)北京展恒基金销售有限公司
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
104)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
105)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:951624008888160
网址:www.cifcofund.com
106)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/
107)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:梁蓉
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客服电话:010-88067525
网站:www.5irich.com
108)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/
109)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
110)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
111)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
112)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:4006877899联系方式:0755-33376922
传真号码:0755-33065516
客服邮箱:service@tenyuanfund.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:林利军
电话:(021)28932888
传真:(021)28932998
联系人:王小练
（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、安冬
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:徐艳、汤骏
业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富社会责任股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为契约型开放式股票型基金。

六、基金的投资目标

精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,谋求基金资产的稳健增值。

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,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金或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%。

本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的80%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金为股票型基金。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积极履行社会责任的优质上市公司,以谋求基金资产稳健增值。

1、资产配置策略

本基金管理人综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中,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P/E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,并在严格管理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

本基金股票投资采用“自下而上”的个股精选策略,精选积极履行社会责任,并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司。为了深刻理解投资对象的特征,持之以恒地贯彻和保持本基金股票投资风格,本基金管理人应用过滤模型来动态建立和维护核心股票库,审慎精选,严格高效管理风险,力求实现本基金投资目标。

首先,在全部股票中,按照本基金投资范围的界定、本基金管理人投资管理制度要求以及股票投资限制,剔除其中不符合投资要求的股票（包括但不限于法律法规或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),筛选得到的公司组成本基金的初选股票库。初选股票库将不定期地更新。

其次,基于初选股票库,本基金管理人从利益相关者责任（包括但不限于上市公司对股东、债权人、职工、国家等的责任)和资源、环境责任（包括但不限于上市公司对生态环保承担的责任)等方面,将净资产收益率、资产负债率、职工获益率、资产纳税率、单位净利润废物排放量等定义为本基金所关注的社会责任指标。各指标具体计算公式如下:

净资产收益率 = 上市公司净利润 ÷ 上市公司平均净资产 × 100%,

资产负债率 = 上市公司负债总额 ÷ 上市公司资产总额 × 100%,

职工获益率 = 上市公司支付职工工资、福利及社保基金总额 ÷ 上市公司营业收入总额 × 100%,

资产纳税率 = 上市公司企业纳税总额 ÷ 上市公司平均资产总额 × 100%,

单位净利润废物排放量 = 上市公司年废物排放量 ÷ 上市公司年净利润 × 100%。

根据上述社会责任指标,本基金管理人对备选股票进行动态综合评级,选择排名在前1/3的上市公司作为积极履行社会责任的上市公司。

在此基础上,本基金管理人通过扎实的案头研究和详尽紧密的实地调研,结合卖方研究的分析,从信息披露、重要股东状况、激励约束机制等方面衡量公司治理结构,从管理层稳定性、工作能力、品行等方面考察管理层,从经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等方面评估竞争优势,从中选择具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司,组成本基金的精选股票库。

然后,在精选股票库的基础上,本基金管理人从内在价值、相对价值、收购价值等方面,考察市盈增长比率(PEG)、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)等一系列估值指标,从中选择估值水平相对合理的公司,组成本基金的核心股票库。

最后,基金经理按照本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据二级市场波动情况构建股票组合并动态调整。

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。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策略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。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

（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;

（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

本基金投资决策流程为:

（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之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)金融工程小组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:

沉深300指数收益率 × 80% + 中证全债指数收益率 × 20%

选择该业绩基准,是基于以下因素:

1、沉深300指数编制合理、透明,有一定市场覆盖率,并且不易被操纵;

2、沉深300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、沉深300指数是中证指数公司编制共同推出的沉深两个市场第一个统一指数;

4、中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沉深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数,该指数的样本由银行间市场和沉深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成;

5、基于本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够真实、客观地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

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6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	914,197,733.92	85.81
	其中:股票	914,197,733.92	85.81
2	固定收益投资	50,902,328.00	4.78
	其中:债券	50,902,328.00	4.78
	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	97,609,495.22	9.16
7	其他资产	2,666,130.68	0.25
8	合计	1,065,375,687.82	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	675,463,921.79	63.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,938.20	0.00
F	批发和零售业	63,498,266.40	5.99
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	130,838,399.49	12.34
J	金融业	31,535,045.53	2.98
K	房地产业	2,325,482.40	0.22
L	租赁和商务服务业	196.64	0.00
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	132.70	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,525,350.77	0.99
S	综合	-	-
	合计	914,197,733.92	86.25

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	002635	安洁科技	2,623,854	83,937,089.46	7.92
2	300312	邦讯技术	2,302,695	53,583,712.65	5.06
3	002414	高德红外	2,799,895	50,930,090.05	4.80
4	002555	顺荣股份	1,055,609	49,698,071.72	4.69
5	002019	鑫富药业	2,039,946	48,469,116.96	4.57
6	300168	万达信息	2,572,260	47,200,971.00	4.45
7	300006	莱美药业	1,485,089	43,216,089.90	4.08
8	300016	北陆药业	3,392,023	42,196,766.12	3.98
9	002475	立讯精密	1,120,078	36,716,156.84	3.46
10	600998	九州通	2,716,012	36,367,400.68	3.43

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	50,000,000.00	4.72
	其中:政策性金融债	50,000,000.00	4.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	902,328.00	0.09
8	其他	-	-
9	合计	50,902,328.00	4.80

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	130227	13国开27	500,000	50,000,000.00	4.72
2	110025	国金转债	7,860	902,328.00	0.09

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: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: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

注: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	673,043.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,879,823.60
5	应收申购款	113,263.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,666,130.68

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	002635	安洁科技	83,937,089.46	7.92	重大事项停牌
2	002019	鑫富药业	48,469,116.96	4.57	重大资产重组停牌

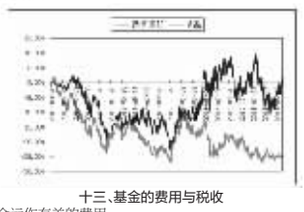
十二、基金的业绩

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)
2011年3月29日(基金合同生效日)至2011年12月31日	-15.60%	0.75%	-21.85%	1.02%	6.25%	-0.27%
2012年1月1日至2012年12月31日	2.13%	1.07%	6.75%	1.02%	-4.62%	0.05%
2013年1月1日至2013年12月31日	16.13%	1.63%	-6.02%	1.12%	22.15%	0.51%
2011年3月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	0.10%	1.23%	-22.19%	1.06%	22.29%	0.17%
2014年1月1日至2014年6月30日	1.60%	1.54%	-4.56%	0.83%	6.16%	0.71%
2011年3月29日(基金合同生效日)至2014年6月30日	1.70%	1.28%	-25.74%	1.02%	27.44%	0.26%

（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

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）基金合同生效后的信息披露费用;

（4）基金份额持有人大会费用;

（5）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

（6）基金的证券交易费用;

（7）基金财产拨划支付的银行费用;

（8）按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

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

在通常情况下,基金管理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×年管理费率÷当年天数(本基金年管理费率为1.50%)

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3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,支付日期顺延。

（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年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年托管费率÷当年天数(本基金年托管费率为0.25%)

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3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,支付日期顺延。

（3）上述“（一）基金费用的种类”中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律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。

3、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。基金募集期间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,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

4、费用的调整

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。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

5、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:

更新了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:

更新了主要人员情况。

三、“四、基金托管人”部分:

更新了证券投资基金托管情况。

四、“五、相关服务机构”部分:

更新了基金份额发售机构的相关信息。

五、“九、基金的投资”部分:

更新了基金投资组合报告。

六、“十、基金的业绩”部分:

更新了基金业绩表现数据。

七、“十四、基金的费用与税收”:

修改了基金管理费、托管费的支付方式。

八、“二十二、其他应披露事项”部分:

更新了2014年3月30日至2014年9月29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
2014年11月7日

招商招财宝货币市场基金更新的招募说明书摘要

（二零一四年第一号）

重要提示

招商招财宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2014年3月13日《关于核准招商招财宝货币市场基金募集的批复》(证监许可（2014)289号文）注册公开募集。本基金的基金合同于2014年3月25日正式生效。本基金为契约型开放式。

投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人就了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2014年9月25日,有关财务和业绩表现数据截止日为2014年6月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:招商基金管理有限公司

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

设立日期:2002年12月27日

法定代表人:张光华

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

电话:(0755)83196351

传真:(0755)83076974

联系人:李涛

招商基金华东机构理财中心

地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦1601室

电话:(021)58796636

联系人:王雷

招商基金华南机构理财中心

地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23楼

电话:(0755)83190452

联系人:刘刚

招商基金养老金及华北机构理财中心

地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座2层西侧 207-219单元

电话:(010)66290540

联系人:刘超

招商基金直销交易服务联系方式

地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦23层招商基金市场部客户服务中心

电话:(0755)83196359 83196358

传真:(0755)83196360

备用传真:(0755)83199266

联系人:贺军莉

2、代销机构:招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:李建红

电话:(0755)83198888

传真:(0755)83196050

联系人:邓炯鹏

(注:仅上线招商招财宝B份额,在招商银行名称为朝朝盈)

基金管理人可根据有关法律法规规定调整销售机构,并及时另行公告。

（二）注册登记机构

名称:招商基金管理有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

法定代表人:张光华

电话:(0755)83196445

传真:(0755)83076436

联系人:宋宇彬

（三）律师事务所和经办律师

名称:上海源泰律师事务所

注册地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人:廖海

电话:(021)51150298

传真:(021)51150338

经办律师:刘佳、张兰

联系人:刘佳

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法定代表人:姚建华

电话:(0755)2547 1000

传真:(0755)8266 8930

经办注册会计师:王国蓓、黄小熠

联系人:蔡正轩

四、基金名称:招商招财宝货币市场基金

五、基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

在兼顾基金资产的安全性和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

七、投资范围

本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的金融工具,包括:现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在1年以内(含1年)的债券回购、中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

法律法规或监管机构允许基金投资其他基金的,且允许货币市场基金投资其他货币市场基金的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下,本基金可参与其他货币市场基金的投资,不需召开持有人大会。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,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

本基金以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对短期金融工具的组合操作,在保持本金的安全性与资产流动性的同时,追求稳定的当期收益。

●根据宏观经济指标、货币政策的研究,确定组合平均剩余到期期限;

●根据各期限各品种的流动性,收益性以及信用水平来确定组合资产配置;

●根据市场资金供给情况对组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整;

●在保证组合流动性的前提下,利用现代金融分析方法和工具,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会。

●合理有效分配基金的现金流,保持本基金的流动性。

1、本基金主要投资策略的制定将依据以下投资方法和技术

（1）收益率曲线研究

短期资金市场供债券市场紧密相关,连接两个市场的分析工具是收益率曲线。本基金将根据债券市场收益率曲线以及隐含的短期收益率和远期利率提供的价值判断基础,为各种投资策略的制定提供决策依据。

（2）短期资金市场的资金供给与需求研究

短期利率是短期资金成本的反映。短期货币资金供应与需求决定了短期利率水平。短期资金市场资金供应量同以下几种因素相关:

●央行公开市场操作的方向、强度、频率以及中标利率水平。短期利率是央行货币政策调控的主要目标之一,央行向短期资金市场注入资金或者从短期资金市场抽出资金,都对短期利率产生重大影响。

●回购市场的交易量、成交的利率水平分布。

●短期资金市场资金供给同资本市场资金供给的关系。一般在股市转暖、一级市场申购增多、新债交款日期附近资金面偏紧。

●货币供应量的季节性因素。一般资金在年末时较为紧张,而在年初时则较为宽松。

通过对这些不同因素的综合考虑,本基金可以概算市场资金供给的充裕程度,据此决定本基金的市场操作策略。

（3）企业信用分析

直接融资的发展是一个长期趋势,企业债、企业短期融资券因此也将成为货币市场基金重要的投资对象。为了保障基金资产的安全。本基金将按照相关法规仅投资于具有资质机构等级要求的企业债券、短期融资券。

与此同时,本基金还将深入分析发行人的财务稳健性,判断发行人违约的可能性,严格控制企业债券、短期融资券的违约风险。

（4）市场结构研究

银行间市场与交易所市场在资金供给者和需求者结构上均存在差异,利率水平因此有所不同。不同类型市场工具由于存在税负、流动性、信用风险上的差异,其收益率水平也略有不同。资金供给者、需求者结构的变化也会引起利率水平的变化。积极利用这些利率差异、利率变化就可能在保证流动性、安全性的基础上为基金资产带来更高的收益率。

2、本基金具体操作策略

（1）滚动配置策略

本基金将根据其投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。

（2）久期控制策略

本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。

（3）套利策略

套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金日身流动性、安全性需要的基础上寻求更高的收益率。

（4）担保品选择策略

股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。

A. 根据宏观经济和短期资金市场的利率走势,来确定投资组合的平均剩余到期期限。具体而言,在预计市场利率上升时,适当缩短投资品种的平均期限;在预计利率下降时,适当延长投资品种的平均期限。市场对利率的预期可以从市场的交易变化和资金流向上反映出来,也可通过不同品种之间反映出的隐含远期利率来评估市场未来