(上接B027版)

(2)基金经理构建、调整投资组合,并在此过程中充分考虑以下因素:每日基金申购和赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究团队的投资建议;绩效与风险评估小组的建议等;

(3)交易执行相关部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(4)风险绩效相关部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告;

(5)监察稽核相关部门对投资合规性进行监控;

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并在基金招募说明书更新中予以公告。

(三)基金的投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会、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的法律责任。

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2012年10月22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。

本报告中所列财务数据截至2012年9月30日(未经审计)。

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	2,463,847,453.65	94.39
	其中:债券	2,463,847,453.65	94.39
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	110,419,968.55	4.23
6	其他资产	36,150,335.62	1.38
7	合计	2,610,417,757.82	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	139,749,000.00	8.73
	其中:政策性金融债	139,749,000.00	8.73
4	企业债券	1,716,741,453.65	107.23
5	企业短期融资券	9,959,000.00	0.62
6	中期票据	597,398,000.00	37.32
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	2,463,847,453.65	153.90

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	112090	12中兴01	2,500,000	246,000,000.00	15.37
2	126019	09长虹债	1,436,590	126,850,897.00	7.92
3	122156	12厦工债	1,250,000	124,987,500.00	7.81
4	122911	10鞍城投	1,245,520	123,306,480.00	7.70
5	122165	12国电03	1,000,000	99,650,000.00	6.22

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,796.94
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	36,129,229.22
5	应收申购款	17,309.46
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	36,150,335.62

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

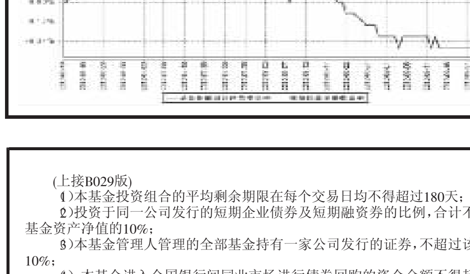
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

七、基金的业绩

1、基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示:

	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
自基金合同生效起至2012年9月30日	-0.10%	0.11%	1.31%	0.01%	-1.41%	0.10%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

注1:业绩比较基准(Benchmark):三年期定期存款税后利率

注2:本基金基金合同于2012年6月13日生效;

注3:基金业绩截止日为2012年9月30日(未经审计)。

八、基金的费用和税收

(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、证券账户开户费用和银行账户维护费;

9、按照国家有关规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

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1.2%

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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。

过渡期内不计提管理费。

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0.2%

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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。

过渡期内不计提托管费。

3、若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人将所持有本基金份额转为转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"的基金份额,管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算方法同上。

4、上述(一)中3到9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。

(三)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、信息披露费等费用不列入基金费用。基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

(四)与基金销售有关的费用

1、本基金申购费率如下:

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户申购费率如下表:

购买金额(M)	申购费率
M<100万	0.6%
100万≤M<500万	0.6%
M≥500万	每笔1000元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率费率如下表:

购买金额(M)	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<500万	0.8%
M≥500万	每笔1000元

投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金",申购费率不高于基金申购金额的5%,具体费率以届时公告为准。

2、本基金赎回费率如下:

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,赎回费总额的50%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率按照持有时间递减,即相关基金份额持有时间越长,所适用的赎回费率越低,具体赎回费率如下表所示(一年按365天计算):

持有年限(Y)	赎回费率
Y<1年	2%
1年≤Y<2年	1.5%
2年≤Y<3年	1.0%
Y≥3年	0%

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,转为转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金",赎回费率最高不超过5%,具体费率以届时公告为准。

3、基金管理人可以在履行相关手续后,在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式,基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。

4、对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

(五)费用调整

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前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(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。

九、基金的保本

(一)保本

本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所对应的认购金额及募集期利息收入之和。

在保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保本金额,则基金管理人应补足该差额,并在保本周期到期日后4 个工作日内将该差额支付至本基金在基金托管人处开立的指定账户。

如果基金管理人未能全额补足保本赔付差额,则基金管理人应在保本周期到期日后5 个工作日内,向保证人发出书面《履行保证责任通知书》。保证人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5 个工作日内,将需清偿的金额支付至本基金在基金托管人处开立的指定账户。

基金管理人最迟应在保本周期到期日后20 个工作日内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

对于基金持有人多次认购或申购、赎回的情况,以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

(二)保本周期

本基金第一个保本周期自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。其后的保本周期及起讫日见基金管理人届时公告。

(三)适用保本条款的情形

1、基金份额持有人认购并持有到期的基金份额。

2、对于认购并持有到期的份额,基金份额持有人无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、转入下一保本周期或是转入转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金",都同样适用保本条款。

(四)不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人持有到期的基金份额的保本金额;

2、基金份额持有人在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额;

3、未经保证人书面同意提供保证,基金份额持有人在本保本周期内申购、转换转入的基金份额;

4、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形;

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且保证人不同意继续承担保证责任;

6、在保本周期到期日之后(不包括该日)基金份额发生的任何形式的净值减少;

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损;或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的,或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

十、基金保本的保证

本节所述基金保本的保证责任仅适用于第一个保本周期。本基金第一个保本周期后各保本周期涉及的基金保本的保障事宜,由基金管理人与保证人或保本义务人届时签订的保证合同或风险买断合同决定,并由基金管理人在当期保本周期开始前公告。

(一)为确保履行保本条款,保障基金份额持有人利益,本基金的第一个保本周期由重庆市三峡担保集团有限公司作为保证人。

(二)保证人基本情况

1、保证人名称

重庆市三峡担保集团有限公司

2、住所

重庆市渝中区中华路178号国际商务中心6楼

3、办公地址

重庆市渝中区中华路178号国际商务中心6楼

4、法定代表人

李卫东

5、成立时间

2006年4月

6、组织形式

有限责任公司

7、注册资本

叁拾亿元人民币

8、经营范围

从事相关法律、法规允许的各种担保业务;企业项目咨询、财务顾问与代理;利用自有资金从事国家法律、法规允许的投资等。

9、其他

重庆市三峡担保集团有限公司前身为重庆市三峡库区产业信用担保有限公司,是经国家发改委批准组建的市级担保公司,于2006年4月成立。2010年1月,公司正式更名为重庆市三峡担保集团有限公司。公司股东为重庆渝富资产经营管理有限公司、中国长江三峡集团公司和国开金融有限责任公司。2011年联合资信评估有限公司评定重庆市三峡担保集团有限公司主体长期信用等级为AA+。

(三)保证人对外承担保证责任的情况

公司主要从事法律法规允许的担保业务,包括但不限于:

1、融资担保

流动资金贷款担保、固定资产担保、银行承兑汇票担保、信用证担保、出口押汇担保

2、金融产品担保

债券担保、信托计划担保、基金担保

3、履约担保

工程履约担保、合同履约担保、商业票据履约担保、设备租赁担保、赊销信用担保

4、专项担保

诉讼保全担保、政府采购担保、特许经营权担保

5、为上述担保业务提供联合担保、反担保和再担保

6、其他业务

截至2011年12月31日,重庆市三峡担保集团有限公司对外提供的担保资产规模为人民币275.84亿元,不超过公司2011年度经审计的净资产(人民币33.93元)的25倍。公司为保本基金承担保证责任的总金额为41.18亿元。

(四)基金管理人与保证人签订《鹏华金刚保本混合型证券投资基金保证合同》。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意该保证合同的约定。本基金保本由保证人提供不可撤销的连带责任保证;保证的范围为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额的差额部分。保证人保证期间为自本基金当期保本周期到期之日起六个月止。第一个保本周期内,保证人承担保证责任的金额最高不超过50亿元人民币。

(五)保证费用的费率和支付方式

1、保证费率

保证费由基金管理人按照基金资产净值的0.2%的年费率从基金管理费收入中列支。保证费用的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的保证费用

E为前一日基金资产净值

2、支付方式

在基金保本周期内,本基金的保证费用从基金管理人的管理费收入中列支。保证费用每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人于每月收到基金管理费之后的2个工作日内支付给保证人。

(六)保本周期内,保证人出现足以影响其担保能力情形的,应在该情形发生之日起三个工作日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人在接到通知之日起三个工作日内应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法。当确定保证人已丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下,基金管理人无须召开基金份额持有人大会,但应根据基金合同的约定尽快确定新的保证人。基金管理人应在接到保证人通知之日起五个工作日内在指定媒体上公告上述情形。

(七)保本周期内,更换保证人应经基金份额持有人大会审议通过,但因保证人发生合并或分立,由合并或分立后的法人或者其他组织承继保证人的权利和义务,以及确认保证人已丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况除外。更换保证人的,原保证人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的保证人承担。在新的保证人接任之前,原保证人应继续承担保证责任。增加保证人的,原保证人继续承担保证责任,新增加保证人和原保证人共同承担连带保证责任。

(八)如果符合条件的基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额,且基金管理人无法全额履行保本义务的,基金管理人在保本周期到期日后五个工作日内,向保证人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明需保证人代偿的金额)。保证人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的五个工作日内,将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户中,由基金管理人将该差额支付给基金份额持有人。保证人将代偿金额全额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户后即为全部履行了保证责任,保证人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。代偿款的分配与支付由基金管理人负责,保证人对此不承担责任。

(九)除本部分第(七)条所指的"更换保证人的,原保证人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的保证人承担"以及下列除外责任情形外,保证人不得免除保证责任:

1、在保本周期到期日,按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于其保本金额;

2、基金份额持有人认购,但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额;

3、未经保证人书面同意提供保证,基金份额持有人在本保本周期内申购或转换转入的基金份额;

4、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形;

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且保证人不同意继续承担保证责任;

6、在保本周期到期日之后(不包括该日)基金份额发生的任何形式的净值减少;

7、基金合同的修改须经保证人书面同意,未经保证人书面同意修改基金合同条款,可能加重保证人保证责任的,但根据法律法规要求进行修改的除外;

8、因不可抗力的原因导致基金投资亏损;或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的,或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

(十)保本周期届满时,如符合法律法规有关保证人或保本义务人资质要求,并经基金管理人认可的保证人或保本义务人继续与基金管理人签订保证合同或风险买断合同,同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的,本基金将转入下一保本周期;否则,本基金转型为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金",保证人不再为该基金承担保证责任。

(十一)更换保证人

1、保本周期内更换保证人的程序

(1)提名

基金管理人、基金托管人、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权提名新保证人,被提名的新保证人应当符合本基金保证人的资质条件,且同意为本基金的保本提供保证。

(2)决议

出席基金份额持有人大会的基金份额持有人,就更换保证人的事项进行审议并形成决议。相关程序应遵循基金合同第八部分"基金份额持有人大会"约定的程序规定。

更换保证人的决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上(含50%)表决通过。

(3)备案:基金份额持有人大会更换保证人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行。基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

(4)保证义务的承继:基金管理人应自更换保证人的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准之日起5个工作日内与新保证人签署保证合同,并将该保证合同向中国证监会报备,新保证合同自中国证监会核准之日起生效。自新保证合同生效之日起,原保证人承担的所有与本基金担保责任相关的权利义务将由继任的保证人承担。在新的保证人接任之前,原保证人应继续承担担保责任。

(5)公告:基金管理人应自新保证合同生效之日起2日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

2、当期保本周期结束后,基金管理人有权更换下一保本周期的保证人,由更换后的保证人为本基金下一保本周期的保本提供保证责任,此项保证人更换事项无需召开基金份额持有人大会决议通过。但是基金管理人应当将涉及新保证人的有关资质情况、保证合同等向中国证监会报备。

十一、基金保本周期的到期

(一)保本周期到期后基金的存续形式

1、保本周期届满时,基金保证人或基金管理人认可的其他符合条件的机构能够继续为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证或者承诺提供保本,同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的,本基金继续存续并进入下一个保本周期,该保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

2、如保本周期届满后,本基金未能符合上述保本基金存续条件,则本基金将按基金合同的约定,转型为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"。此基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据本基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后,可不经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。

3、如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求,则本基金将根据本基金合同的规定终止。

(二)到期操作方式

1、本基金保本周期到期前,基金管理人将提前公告并提示基金份额持有人进行到期操作。到期操作期间为基金管理人公告指定的包括保本周期到期日及之后的三个工作日,共计四个工作日。

2、本基金到期操作期间,基金份额持有人可以做出如下选择:

(1)赎回基金份额;

(2)将基金份额转换为基金管理人管理的已开通基金转换业务的其他基金份额;

(3)若基金份额持有人没有作出上述(1)、(2)项到期选择,且本基金符合保本基金存续条件的,基金管理人将根据届时的公告默认基金份额持有人选择将其持有的基金份额转入下一个保本周期;

(4)若基金份额持有人没有作出上述(1)、(2)项到期选择,且本基金不符合保本基金存续条件并按基金合同的约定转型为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金",基金管理人将根据届时的公告默认基金份额持有人选择继续持有转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"的基金份额。

3、基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种处理方式之一,也可以部分选择赎回、转换出、转入下一个保本周期或继续持有转型后基金的基金份额。

4、无论持有人采取何种方式做出到期选择,均无需就其符合保本条件的基金份额在到期操作期间的赎回和转换支付赎回费用和转换费用等交易费用。

5、到期操作采取"未知价"原则,即在到期操作期间,基金份额持有人赎回本基金基金份额或将本基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的,赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际操作日的本基金基金份额净值为基准进行计算。对于当期保本周期到期日之后(不含保本周期到期日)至赎回或者基金间转换的实际操作日(含该日)的基金份额净值波动的风险应由基金份额持有人自行承担。

6、在到期操作期间,本基金将暂停日常申购和转入业务。

7、本基金的到期操作期间,除暂时无法变现的基金财产外,基金管理人应使基金财产保持为现金或到期日在一年以内的政府债券。

(三)本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时,保证人或基金管理人认可的其他符合条件的保证人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障,与基金管理人就本基金下一保本周期签订保证合同或风险买断合同,同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的,本基金继续存续并进入下一保本周期。

基金管理人可根据到期操作期间基金份额持有人的选择情况决定本基金进入下一保本周期前是否进入过渡期并开放过渡期申购。

1、不进入过渡期的情形

若基金份额持有人在到期操作期间默认选择转入下一个保本周期的基金份额所代表的资金净值总额超过保证人提供的下一个保本周期保证额度或保本义务人提供的下一个保本周期保本额度的,基金将不进入过渡期,直接进入下一个保本周期。基金份额持有人在下一个保本周期可享受保本条款的基金份额数的具体确认方法由基金管理人届时公告。

2、过渡期和过渡期申购

若没有发生基金不进入过渡期的情形,则到期操作期间结束后基金进入过渡期。

到期操作期间结束后第一个工作日起至下一保本周期开始日前一工作日止的期间为过渡期,过渡期最长不超过20个工作日,具体日期由基金管理人届时公告。

投资者在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为"过渡期申购"。在过渡期内,投资者转换入本基金基金份额,视同为过渡期申购。

(1)基金管理人将根据保证人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

(2)过渡期申购采取"未知价"原则,即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

(3)投资者进行过渡期申购的,其持有相应基金份额至过渡期最后一日(含该日)期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

(4)过渡期申购费率

过渡期申购费率最高不超过5%,具体费率在届时更新的《招募说明书》或相关公告中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(5)过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。

(6)过渡期内,本基金将暂停办理日常赎回、转换出业务。

(7)过渡期内,基金管理人应使基金财产保持为现金或到期日在一年以内的政府债券,基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

3、基金份额折算

若按基金合同约定的情形基金不进入过渡期,则到期操作期间最后一日为基金份额折算日;若按基金合同约定的情形基金进入过渡期,则过渡期最后一个工作日为基金份额折算日,基金份额折算日为下一保本周期开始日前一工作日。

在基金份额折算日,基金份额持有人所持有的基金份额(包括投资者过渡期申购的基金份额和/或到期操作期间默认选择转入下一个保本周期的基金份额持有人所持有的基金份额)在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下,变更登记为基金份额净值为1.00元的基金份额,基金份额数额按折算比例相应调整。

在基金份额持有人赎回基金份额时,持有期的计算仍以投资者认购、申购、转换入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算,不受基金份额折算的影响。

4、开始下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日,本基金进入下一保本周期运作。基金管理人以过渡期申购和/或从上一保本周期转入的基金份额在折算日所代表的资产净值确定为本基金转入下一保本周期时的基金资产。

基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间默认选择转入下一保本周期的基金份额和/或过渡期申购的基金份额,经基金份额折算后,适用下一保本周期的保本条款。

本基金进入下一保本周期后,仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务。

自本基金下一保本周期开始后,本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过3个月。

(四)转为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"资产的形成

保本周期届满时,若不符合保本基金存续条件,本基金转型为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"。

1、对于投资者在本基金募集期内认购的基金份额、保本周期内申购或转换入的基金份额,默认选择转为转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"的,转入金额等于默认选择转为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"的基金份额在"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。

2、转型后的"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金"申购的具体操作办法由基金管理人提前公告。

(五)保本周期到期的公告

1、保本周期届满时,若符合保本基金存续条件,本基金将继续存续。基金管理人应依照法律法规规定就本基金继续存续及为下一保本周期开放申购的相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时,若不符合保本基金存续条件,本基金将转型为"鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金",基金管理人将在临时公告或《鹏华宏观灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。

3、在保本周期到期前,基金管理人将进行提示性公告。

(六)保本周期到期的赔付

1、在发生保本赔付的情况下,基金管理人应补足保本赔付差额,并在保本周期到期日后4个工作日内将该差额支付至本基金在基金托管人处开立的指定账户。

如果基金管理人未能全额补足保本赔付差额,则基金管理人应在保本周期到期日后5 个工作日内,向保证人发出书面《履行保证责任通知书》,保证人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5 个工作日内,将需清偿的金额支付至本基金在基金托管人处开立的指定账户。

基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

2、保本赔付资金到账后,基金管理人应按照基金合同的约定进行分配和支付。

3、发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,本基金管理人对本基金原公告的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期和基金合同生效日。

2、对"二、释义"部分内容进行了更新。

3、对"三、基金管理人"部分内容进行了更新。

4、对"四、基金托管人"部分内容进行了更新。

5、对"五、相关服务机构"内容进行了更新。

6、对"六、基金的募集和基金合同的生效"内容进行了更新。

7、对"七、基金份额的申购与赎回"内容进行了更新。

8、对"十、基金的投资"部分内容进行了更新。

9、新增了"十一、基金的业绩"的相关内容。

10、对"十七、基金的信息披露"中部分内容进行了更新。

11、对"二十三、对基金份额持有人的服务"内容进行了更新。

12、对"二十四、其他应披露事项"内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2013年1月25日

(上接B029版)

(1)本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天;

(2)投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例,合计不得超过基金资产净值的10%;

(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%;

(5)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(6)本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;

(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%;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%;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%;本基金应投资于信用级别评级为AAA以上(含AAA)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;

(8)本基金投资的短期融资券的信用评级,应不低于以下标准:

1)国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别;

2)根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券,其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一:

i)国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的长期信用级别;

ii)国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别(例如,若中国主权评级为A-级,则低于中国主权评级一个级别的为BBB+级)。

3)同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的,以国内信用级别为准。

4)本基金持有短期融资券期间,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20个交易日内予以全部减持。

(9)中国证监会规定的其他比例限制。

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五日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。

3、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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。

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业绩基准时,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。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

投资组合报告

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	固定收益投资	1,272,702,731.01	29.45
	其中:债券	1,272,702,731.01	29.45
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	3,010,177,096.29	69.65
4	其他资产	38,892,843.71	0.90
5	合计	4,321,772,671.01	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.32
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	221,299,490.55	5.43
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:"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%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

3、 基金投资组合平均剩余期限

3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	157
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	49.84	5.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)-60天	6.14	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	13.51	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)-180天	7.88	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.20	–
5	180天(含)-397天(含)	27.77	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	105.14	5.43

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	摊余成本(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	299,715,772.93	7.36
	其中:政策性金融债	299,715,772.93	7.36
4	企业债券	30,403,595.87	0.75
5	企业短期融资券	942,583,362.21	23.14
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	1,272,702,731.01	31.24
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	89,727,332.32	2.20

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100229	10国开29	1,800,000	179,986,777.73	4.42
2	011209001	12国电集SCP001	1,000,000	100,280,957.14	2.46
3	120227	12国开27	900,000	89,727,332.32	2.20
4	041253037	12联通CP001	700,000	70,027,057.41	1.72
5	041156012	11豫投资CP001	500,000	50,295,848.50	1.23
6	041253013	12华能集CP001	500,000	50,265,346.41	1.23
7	041258040	12中交建CP002	500,000	49,999,643.97	1.23
8	041260036	12陕煤化CP001	500,000	49,990,068.97	1.23
9	041252032	12二重CP001	400,000	40,036,637.87	0.98
10	041272002	12富邦CP001	400,000	39,967,122.65	0.98

6、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.00%
报告期内偏离度的最低值	-0.09%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.03%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8、投资组合报告附注

8.1本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

8.2本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.3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、处罚的情形。

8.4其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	37,772,243.71
4	应收申购款	870,600.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	38,892,843.71

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2012年9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:

汇添富理财60天债券A

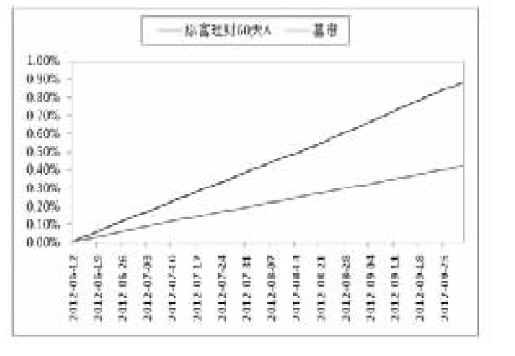
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年9月30日	0.8795%	0.0008%	0.4120%	0.0000%	0.4675%	0.0008%

汇添富理财60天债券B

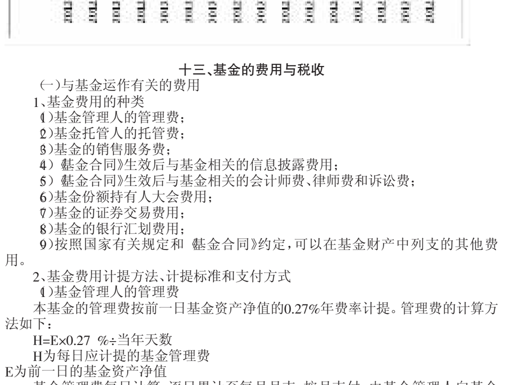
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2012年6月12日(基金合同生效日)至2012年9月30日	0.9693%	0.0008%	0.4120%	0.0000%	0.5573%	0.0008%

(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

汇添富理财60天债券A



汇添富理财60天债券B



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)基金的销售服务费;

(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)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。

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0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.27 %÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前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0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.08%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2 个工作日内从基金财产中一次性支取。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A 类基金份额的销售服务费年费率为0.30%,对于由B 类降级为A类的基金份额持有人,基金年销售服务费率应自其达到A 类条件的开放日后的下一个工作日起适用A 类基金份额持有人的费率。

本基金B 类基金份额的销售服务费年费率为0.01%,对于由A 类升级为B 类的基金份额持有人,基金年销售服务费率应自其达到B 类条件的开放日后的下一个工作日起适用B 类基金份额持有人的费率。

各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出,经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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。

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;

(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、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:

增加了本基金合同生效日、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:

更新了基金管理人法定代表人、董事长、监事长及基金经理人员相关信息。

三、"四、基金托管人"部分:

更新了基金托管人情况以及内部控制制度相关信息。

四、"五、相关服务机构"部分:

更新了基金份额发售机构、注册登记机构、会计师事务所相关信息。

五、"七、基金的募集"部分:

增加了基金募集情况。

六、"八、基金合同的生效"部分:

增加了基金合同生效日。

七、"九、基金份额的申购与赎回"部分:

增加了开始办理日常申购、赎回业务的日期。

八、"十、基金的投资"部分:

增加了基金投资组合报告。

九、"十一、基金的业绩"部分:

增加了基金业绩表现数据。

十、"十三、基金资产的估值"部分。

增加了本基金基金合同中有关估值错误的处理相关内容。

十一、"二十、基金合同的内容摘要"部分。

增加了本基金基金合同中有关争议的处理相关内容。

十二、"二十一、基金托管协议的内容摘要"部分。

更新了基金管理人法定代表人姓名、托管人注册资本信息,增加了本基金托管协议中"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%"的投资限制约定。

十一、"二十三、其他应披露事项"部分:

增加了2012年6月12日至2012年12月12日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理有限公司

2013年1月25日

汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2013年1月25日

1. 公告基本信息

基金名称	汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富理财21天债券发起式	
基金主代码	470021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月24日	
基金管理人名称	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国银行股份有限公司	
公告依据	根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定。	
下属分级基金的基金简称	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B
下属分级基金的交易代码	470021	471021

2. 基金募集情况

基金名称	证监许可【2012】1587号			
基金募集期间	自 2013年1月15日 至 2013年1月22日 止			
验资机构名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)			
募集资金划入基金托管专户的日期	2013年1月24日			
募集有效认购总户数(单位:户)	9872			
份额级别		汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B	合计
募集期间净认购金额(单位:人民币元)		4,973,481,779.37	390,841,501.20	5,364,323,280.57
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)		585,224.86	32,125.69	617,350.55
募集份额(单位:份)	有效认购份额	4,973,481,779.37	390,841,501.20	5,364,323,280.57
	利息结转的份额	585,224.86	32,125.69	617,350.55
	合计	4,974,067,004.23	390,873,626.89	5,364,940,631.12
募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	–	10,000,000.00	10,000,000.00
	占基金总份额比例	–	2.56%	0.19%
	其他需要说明的事项	–	管理人于2013年1月22日认购本基金B类份额,无认购费用。	–
募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	–	–	–
	占基金总份额比例	–	–	–
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件	是			
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期	2013年1月24日			

注:1、按照有关法律规定,本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由基金管理人承担。

2、本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

3. 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理公司固有资金	10,000,000.00	0.19%	10,000,000.00	0.19%	认购的基金份额持有期限不低于三年
基金管理公司高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理公司股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,000.00	0.19%	10,000,000.00	0.19%	–

4. 其他需要提示的事项

汇添富基金管理有限公司高度重视投资者服务和投资者教育,特此提醒投资者需正确认知基金投资的风险和长期收益,做理性的基金投资人,做明白的基金投资人,享受长期投资的快乐!

特此公告。

汇添富基金管理有限公司

2013年1月25日

关于汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告

公告送出日期:2013年1月25日

1公告基本信息

基金名称	汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富理财21天债券发起式	
基金主代码	470021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月24日	
基金管理人名称	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	汇添富基金管理有限公司	
公告依据	根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《汇添富理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定。	
申购起始日	2013年1月28日	
赎回起始日	2013年2月18日(为认购期基金份额的第一个运作期到期日)	
下属分级基金的基金简称	汇添富理财21天债券发起式A	汇添富理财21天债券发起式B
下属分级基金的交易代码	470021	471021
该分级基金是否开放申购、赎回	是	是

2 日常申购、赎回业务的办理时间

本基金办理日常申购、赎回的时间为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日(本公司公告暂停时除外)的交易时间(9:30-15:00)。

重要提示:注册登记机构仅在运作期到期日受理赎回申请。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

1、投资者通过代销机构网点申购本基金基金份额单笔最低金额为人民币1000元(含申购费);通过基金管理人直销中心首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币50000元(含申购费);通过基金管理人网上直销系统(trade.99fund.com)申购本基金基金份额单笔最低金额为人民币1000元(含申购费)。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的,以各代销机构的业务规定为准。

2、投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时,不受最低申购金额的限制。

3、投资者可多次申购,对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

4、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

3.2 申购费率

本基金无申购费用。

3.3 其他与申购相关的事项

本基金申购采用"金额申购"方式,申购价格为每份基金份额净值1.00元,计算公式:

申购份额=申购金额/1.00元

申购份额的计算保留小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资者可将其全部或部分基金份额赎回,赎回最低份额1份,基金份额持有人在销售机构保留的基金份额不足1份的,注册登记系统将全部剩余份额自动发起赎回。

4.2 赎回费率

本基金无赎回费用。

4.3 其他与赎回相关的事项

本基金采用"份额赎回"方式,赎回价格为每份基金份额净值1.00元。赎回金额的计算公式为:

赎回金额=赎回份额×基金份额净值+该运作期内的未支付收益

重要提示:对于持有超过一个运作期、在当期运作期到期日提出赎回申请的基金份额而言,除获得当期运作期的基金未支付收益外,基金份额持有人还可以获得自申购确认日(认购份额自本基金合同生效日)起至上一运作期期末的基金收益。

示例:

例1:投资者A于2013年2月19日(周二)申请购买10000份基金份额,则该申购份额的第一个运作期为2013年2月19日至2013年3月12日(周二),第一个运作期共21天,基金年化收益率为5%。

若投资者A于3月12日提出赎回申请,则投资者A可获得的赎回金额为:

10000份*1+10000*5%*21天/365天=10028.77元。

例2:投资者B于2013年2月19日(周二)申请购买10000份基金份额,则该申购份额的第一个运作期为2013年2月19日至2013年3月12日(周二),第一个运作期共21天,基金年化收益率为5%。

若投资者B未于3月12日提出赎回申请,则第一期收益结转后的基金份额变为:10000份*(1+5%*21天/365天)=10028.77份。

该基金份额自3月13日起进入第二个运作期,第二个运作期到期日为2013年4月2日(周二),第二个运作期共21天,第二个运作期基金年化收益率为5.5%。

若投资者B于4月2日提出赎回申请,则投资者B可获得的赎回金额为:5.5%*10028.77份*21天/365天+1元*10028.77份=10060.50元。

若投资者B未于4月2日提出赎回申请,则自4月3日起进入第三个运作期,第三个运作期到期日为4月23日(周二),即申购申请日(2月19日)次九周的对日。投资者B可于4月23日赎回基金份额,若不赎回则于4月24日进入下一个运作期。以此类推。

5 日常转换业务

本基金目前暂不开通转换业务,具体开通转换业务情况以届时公告为准。

6 定期定额投资业务

本基金目前暂不开通定期定额投资业务,具体开通定期定额投资业务情况以届时公告为准。

7 基金销售机构

7.1 场外销售机构

7.1.1 直销机构

汇添富基金管理有限公司直销中心,汇添富基金管理有限公司网上直销系统(trade.99fund.com)办理本基金的申购、赎回业务。

7.1.2 场外代销机构

1)办理本基金申购、赎回的代销机构

中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西南证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司。

8 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

基金管理人将按照《基金合同》的约定披露各类基金份额净值。

9 其他需要提示的事项

1、本公告仅对本基金开放日常申购、赎回的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读刊登于本公司网站(www.99fund.com)的本基金《基金合同》和《招募说明书》等法律文件,还可拨打本公司客户服务热线(400-888-9918)咨询相关信息。

2、投资者在本基金销售机构办理基金投资事务,具体办理规则及程序请遵循各销售机构的规定。

汇添富基金高度重视投资者服务和投资者教育,特此提醒投资者需正确认知基金投资的风险和长期收益,做理性的基金投资人、做明白的基金投资人,享受长期投资的快乐!

特此公告。

汇添富基金管理有限公司

2013年1月25日