(上接A30版)

网址:http://www.fund123.cn/

100)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:敖玲

电话:021-58788678-8201

传真:021—58787698

客服电话:400-089-1289

公司网站:www.erichfund.com

101)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

邮政编码:100029

法定代表人:闫振杰

电话:010-62020088

传真:010-62020088-8002

102)中期时代基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层邮编:100020

办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基大厦15层

法定代表人:路瑶

公司网址:www.cifcofund.com

客服热线:95162、4008888160、010-59539718、59539728

103)上海利得基金销售有限公司

注册地址:宝山区蕴川路5475号1033室

地 址:中国上海浦东新区东方路989号中达大厦201室

电话:86-021-50583533

传真:86-021-50583633

网址:www.leadfund.com.cn

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)基金注册登记机构

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:通力律师事务所

住所:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼

负责人:韩炯

经办律师:秦悦民、傅轶

电话:021-68818100

传真:021-68816880

(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:汇添富蓝筹稳健灵活配置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

通过投资于价值相对低估的蓝筹公司股票,追求基金资产的长期增值。

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、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票投资占基金资产的比例为30-80%,债券及资产支持证券投资占基金资产的比例为0-60%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金和到期日在1年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金股票投资对象为蓝筹公司,蓝筹公司是指凭借优秀的管理能力和高品质的产品或服务,在长期持续的经营中建立了良好的品牌和信誉,从而在行业内具有领先地位的大市值公司。本基金股票资产全部投资于蓝筹公司。

今后在有关法律法规许可时,本基金资产配置比例可作相应调整,股票资产投资比例可达到法律法规有关规定的限额。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整;在股票投资中,采取“自下而上”的策略,优选价值相对低估的蓝筹公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。本基金投资策略的重点是资产配置和精选股票策略。

1、 资产配置策略

在资产配置中,本基金运用以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定股票、债券和现金类资产(现金和到期日在1年以内的政府债券)等资产类别的预期收益、风险和各种情景发生的概率,在有效控制投资组合风险的前提下,提出对各类别资产的配置建议,由基金经理向投资决策委员会提交报告以形成决议。

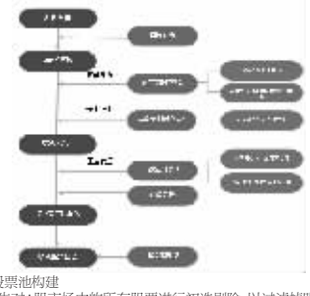
在上述确定的资产配置比例下,本基金将根据市场估值、市场资金、投资主体行为和市场信心影响等因素进行综合判断,提出对各类别资产配置的调整建议,由基金经理向投资决策委员会提交各类别资产配置比例的调整建议;投资决策委员会召开会议,讨论基金经理的建议并确定各类别资产配置的调整比例,由基金经理执行。

2、 股票投资策略

本基金致力于投资价值相对低估的蓝筹公司股票。蓝筹公司是指凭借优秀的管理能力和高品质的产品或服务,在长期持续的经营中建立了良好的品牌和信誉,从而在行业内具有领先地位的大市值公司。

为达精选之目的,本基金结合定量分析和定性分析,通过构建“初选股票池—蓝筹股票池—核心蓝筹股票池”三级过滤模型(Tri-Filtering Model)来逐级优选股票,在确定蓝筹公司普遍特征基础上,发掘具有良好成长性或具有价值回归潜力的蓝筹公司股票进行投资布局;同时将风险管理意识贯穿于股票投资过程中,对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。下图是本基金股票组合构建流程。

汇添富蓝筹稳健基金股票投资组合构建流程



(1)初选股票池构建

本基金首先对A股市场中的所有股票进行初选剔除,以过滤掉明显不具备投资价值的股票,建立初选股票池,从而缩小研究范围,提高工作效率。剔除的股票包括法律法规和本基金管理人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。

(2)蓝筹股票池构建

在初选股票池的基础上,本基金结合定量筛选评估和定性分析,挑选具有蓝筹公司普遍特征的股票构建蓝筹股票池。具体有以下步骤:

1)定量筛选,根据总市值标准筛选股票构建蓝筹股票池基础框架

基于对蓝筹公司特征的深入研究,本基金将首先运用总市值标准进行定量筛选,在初选股票池的基础上,构建蓝筹股票池基础框架。

本基金根据总市值整体排名和总市值行业内排名进行定量筛选。经过定量筛选后,本基金蓝筹股票池基础框架包含以下两部分:

① 每半年按照总市值从高到低对初选股票池进行排序,排名前三分之一的股票;

② 根据中国证监会行业分类标准对初选股票池进行分类,每半年按照总市值从高到低对各行业中股票进行排序,排名各行业前三分之一的股票。

同时,在相邻两次排序期间,如果由于新股发行、公司重组合并以及整体上市等因素导致相关股票的总市值大于上述第一部分排名最末股票的总市值,或者大于上述第二部分相应行业排名最末股票的总市值,则将该股票纳入蓝筹股票池基础框架。

2)定性分析,挑选具有蓝筹公司普遍定性特征的股票,构建蓝筹股票池

通过对国内外蓝筹公司特征的深入研究,本基金认为蓝筹公司除具有较大市值规模外,还具有一些普遍的定性特征,包括:

① 领先的行业地位。蓝筹公司一般为行业龙头或产业领袖,往往主导产业价值链并引导产业发展方向;

② 持续的经营历史。蓝筹公司往往拥有持续的经营历史,能够较好地适应不同的经济发展环境和周期,生存和发展能力较强;

③ 高品质的产品或服务。蓝筹公司往往凭借强大的技术实力、领先的信息优势以及庞大的营销网络为客户提供高品质的、值得信赖的产品或服务,这也是蓝筹公司占据市场统治地位并获得可持续发展的重要原因;

④ 良好的品牌和信誉。蓝筹公司往往因其长期为客户提供值得信赖的优质产品或服务而获得客户的广泛认可,因而拥有超值品牌和极高的信誉度;

⑤ 优秀的管理能力。蓝筹公司往往拥有卓越的管理能力、管理理念创新,管理架构稳定。

基于对上述蓝筹公司普遍定性特征的认识,本基金在根据总市值进行初步筛选后,将通过公司实地调研和基本面分析,进一步挑选出具有上述蓝筹公司定性特征的股票,完成蓝筹股票池构建。

3)蓝筹股票池调整

在构建蓝筹股票池的过程中,本基金每半年对所有A股股票按照总市值进行排序筛选,因此本基金蓝筹股票池按照基金会计年度每半年调整一次。

本基金将根据上述定量筛选和定性分析标准对蓝筹股票池进行定期调整。

(3)核心蓝筹股票池构建

在蓝筹股票池基础上,本基金将结合定量评估、定性分析和估值分析,发掘具有良好成长性或价值回归潜力且价值相对低估的蓝筹公司股票,构建核心蓝筹股票池。具体有以下步骤:1.定量评估和定性分析相结合,发掘具有良好成长性或价值回归潜力的蓝筹公司

在蓝筹股票池基础上,本基金将发掘以下两类蓝筹公司:

① 具有良好成长性的蓝筹公司;

② 具有价值回归潜力的蓝筹公司。

具体来说:

① 发掘具有良好成长性的蓝筹公司

本基金采用以下定量标准挑选具有良好成长性的蓝筹公司:

预期未来两年主营业务收入增长率大于GDP(即国内生产总值)增长率。

在预测蓝筹公司未来两年主营业务收入增长率时,本基金将主要考察下列因素:

1、公司历史主营业务收入增长率。历史财务指标具有客观、定量的优点,尤其是当公司基本因素相对稳定的时候,采用历史外推法具有良好的预期效果。本基金在预测公司主营业务收入增长率时将参考其历史主营业务收入增长率;

2、公司产量的增加或服务的提升。产量或服务的扩张是公司实现业务收入增长的主要方式。本基金将密切关注蓝筹公司产量增加或服务提升计划、新项目投资进展、产量增加或服务提升制约因素以及实现程度等重要因素;

3、公司主导的产品或服务市场供求变化趋势。在考察蓝筹公司主导的产品或服务市场供求变化趋势时,本基金将重点关注产品或服务生命周期处于成长期的蓝筹公司,因为在此阶段的产品或服务需求量大但竞争者少,产品或服务供不应求,为公司主营业务的快速增长奠定了基础,在这种市场供求趋势下,预期公司将会有较高的主营业务收入增长率;

4、公司产品或服务的差异性。产品或服务的差异性是蓝筹公司提高客户转换成本、保持较高定价能力、扩大市场份额进而促进主营业务收入增长的重要基础。成长性蓝筹公司除提供高品质的产品或服务外,其产品或服务还应具有一定的差异性,如果差异性大,则其产品或服务较难替代,主营业务收入增长率预期会有较好的保障;

5、公司的研发实力和投入。较强且具有持续性的技术研发能力和持续有效的研发投入,可以使蓝筹公司所掌握的技术不断地转化为新产品或新服务,从而为其成长提供源源不断的动力。本基金将重点考察公司新产品推出速度以及有效研发费用投入率等相关指标。

② 发掘具有价值回归潜力的蓝筹公司

具有价值回归潜力的蓝筹公司是指虽不具备较高的成长潜力,但基本面向好,具有较大安全边际的蓝筹公司。在发掘具有价值回归潜力的蓝筹公司时,本基金重点关注下列特征:

1、公司治理结构合理,管理较为规范;

2、盈利模式清晰且具备可持续性,在生产经营、产品研发以及售后服务等方面拥有较强的、不易为竞争对手所模仿的核心竞争力;

3、具有良好的财务状况、资本结构合理,资产质量较好;

4、具有低于行业平均水平的市盈率(PE)和市净率(PB);

5、拥有良好的股利支付记录和股利支付预期。过去三年内具有分红历史,重点关注持续两年分红的蓝筹公司;同时,具有较强的分红意愿和良好的分红预期。

除关注具有上述特征的蓝筹公司外,本基金还将关注以下具有价值回归潜力的蓝筹公司:

① 并购重组型蓝筹公司:预期发生资产重组,将可能会对公司经营业绩和未来发展前景产生重大和实质性影响,使公司价值可能在一定时期内低估;

② 资源富余型蓝筹公司:拥有未被市场认识的或被市场低估的资源,导致公司市场价值低于公司内在价值。

2)进行估值分析,挑选出价值相对低估的蓝筹公司股票,构建核心蓝筹股票池。

在挑选出上述两类蓝筹公司后,本基金将进行估值分析,进一步挑选价值相对低估的蓝筹公司,构建核心蓝筹股票池。

在估值分析方面,本基金将基于定性定量分析、动态静态指标相结合的原则,采用内在价值、相对价值以及收购价值相结合的评估方法,如动态市盈率(PEG)、市盈率(PE)、市净率(PB)、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,对上述具有良好成长性或价值回归潜力的蓝筹公司进行价值评估,从而挑选出价值相对低估的股票,完成核心蓝筹股票池的构建。

(3)股资组合构建

基金经理根据本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,构建投资组合并动态调整。

(4)持续跟踪和风险评估

对所投资的蓝筹公司进行密切跟踪,保持精密的风险意识,关注发展变化,动态评估公司价值,同时由金融工程小组通过流动性测试、压力测试、情景分析和VaR分析等技术对投资组合进行动态风险评估。

3、 债券投资策略

本基金将通过资产配置将一部分基金资产投资于债券,包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、企业债、可转债、央行票据和资产支持证券等;此外,市场未来推出的各类固定收益证券及其衍生品也可能成为本基金的投资对象。

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。

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。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。

4、 权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略,以充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的;在个证层面上,充分发掘可能的套利机会,以达到增值的目的。

本基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证,并可以根据证券交易所的有关规定卖出或行权或行权。

本基金将根据权证投资策略主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

其他权证类资产的投资遵从法律法规或监管部门的相关规定。

(一)投资决策依据和决策程序

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,设立了投资研究总部,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、投资主题以及市场环境等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)投资研究总部提交蓝筹股票池,在此基础上,基金经理和行业研究员决定核心蓝筹股票池名单;

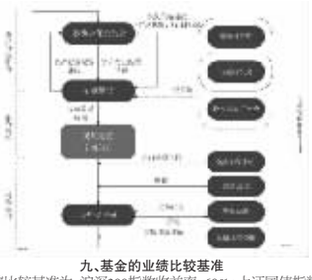
(5)基金经理在考虑资产配置的情况下,经过风险收益的权衡,决定投资组合方案;

(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。

投资决策机制与流程



九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

本基金是灵活配置混合型基金。基于本基金资产配置比例、股票投资对象和指数的市场代表性,本基金选择市场代表性较好的沪深300指数和上证国债指数加权作为本基金的业绩比较基准。选用该业绩比较基准能够较为忠实反映本基金的风险收益特征,同时也能比较贴切地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股票指数时,本基金可以与基金托管人协商一致并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

本基金为灵活配置混合型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

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2013年4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2013年1月1日起至3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	236,966,370.08	69.12
	其中:股票	236,966,370.08	69.12
2	固定收益投资	43,426,504.80	12.67
	其中:债券	43,426,504.80	12.67
	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	60,979,955.88	17.79
6	其他资产	1,466,042.82	0.43
7	合计	342,838,873.58	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,390,000.00	1.29
B	采掘业	8,718,000.00	2.57
C	制造业	143,319,142.26	42.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	29,497,292.60	8.68
F	批发和零售业	8,995,000.00	2.65
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	-	-
J	金融业	21,227,000.00	6.25
K	房地产业	7,423,000.00	2.18
L	租赁和商务服务业	9,896,935.22	2.91
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,500,000.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	236,966,370.08	69.74

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	600594	益佰制药	1,000,058	29,551,713.90	8.70
2	002325	洪涛股份	1,050,019	16,170,292.60	4.76
3	300039	上海凯宝	500,000	15,870,000.00	4.67
4	601166	兴业银行	700,000	12,110,000.00	3.56
5	002140	东华科技	400,000	11,592,000.00	3.41
6	000651	格力电器	400,000	11,428,000.00	3.36
7	600596	新安股份	800,046	10,928,628.36	3.22
8	000400	许继电气	400,000	10,560,000.00	3.11
9	601888	中国国旅	300,089	9,896,935.22	2.91
10	600000	浦发银行	900,000	9,117,000.00	2.68

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	20,004,000.00	5.89
	其中:政策性金融债	20,004,000.00	5.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,440,000.00	6.02
7	可转债	2,982,504.80	0.88
8	其他	-	-
9	合计	43,426,504.80	12.78

1.5 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	1182312	11五矿MTN2	200,000	20,440,000.00	6.02
2	120405	12农发05	200,000	20,004,000.00	5.89
3	110015	石化转债	26,620	2,982,504.80	0.88

1.6 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

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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

1.8 投资组合报告附注

1.8.1

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。

1.8.2

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。

1.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	160,966.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,032,940.54
5	应收申购款	272,135.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,466,042.82

1.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	2,982,504.80	0.88

1.8.5 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有流通受限股票。

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。

(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)
2008年7月8日(基金合同生效日)至2008年12月31日	3.00%	0.18%	-19.33%	1.78%	22.33%	-1.60%
2009年1月1日至2009年12月31日	54.16%	1.56%	58.37%	1.21%	-4.21%	0.35%
2010年1月1日至2010年12月31日	8.15%	1.28%	-6.22%	0.95%	14.37%	0.33%
2011年1月1日至2011年12月31日	-20.00%	0.92%	-13.39%	0.78%	-6.61%	0.14%
2012年1月1日至2012年12月31日	3.93%	0.86%	5.87%	0.77%	-1.94%	0.09%
2013年1月1日至2013年3月31日	6.03%	1.18%	-0.32%	0.93%	6.35%	0.25%
2008年7月8日(基金合同生效日)至2013年3月31日	51.37%	1.13%	0.30%	1.07%	51.07%	0.06%

(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。

本基金终止清算时所发生费用,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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷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2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2.5‰÷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。

上述一、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。

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、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,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《基金份额的申购与赎回》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《基金份额的申购与赎回》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《基金份额的申购与赎回》相应内容。

十四、对招募说明书更新部分的说明

一、重要提示”:

更新了本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”:

更新了主要人员情况。

三、四、基金托管人”:

1、更新了主要人员情况。

2、更新了基金托管业务经营情况。

四、五、 相关服务机构”:

更新了基金份额发售机构的相关信息。

五、 九、 基金的投资”:

更新了基金投资组合报告。

六、十、 基金的业绩”:

更新了本基金业绩表现数据。

七、“二十二、其他应披露事项”:

更新了2013年1月9日至2013年7月8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8月21日

证券代码:002145 公司简称:中核钛白 公告编号:2013—066

中核华原钛白股份有限公司 关于股东股权解除质押的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本公司于 2013 年 8月 20 日收到公司股东武汉九洲弘羊投资发展有限公司(下称九洲弘羊)通知,九洲弘羊于 2012 年 9月 4日质押给自然人严琳的本公司股权 1000 万股(占公司总股本的 2.44%),已经于2013年8月19日申请解除质押,并取得登记公司的《解除证券质押登记通知》。

九洲弘羊共持有本公司股份 2,147.9232 万股,占公司总股本的5.24%,本次部分解除质押后,目前该股东质押股份为700万股,占公司总股本的 1.71%。

特此公告。

中核华原钛白股份有限公司

董事会

2013年8月21日

证券代码:002390 证券简称:信邦制药 公告编号:2013-065

贵州信邦制药股份有限公司 关于重大资产重组进展情况的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

贵州信邦制药股份有限公司(以下简称“公司”)于 2013 年 5 月 31日发布了《关于重大资产重组停牌的公告》,公司正在筹划收购资产重大项目事项,公司股票已于 2013年5月31日开市起停牌(详见公司于2013年 5 月 31 日刊登在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网www.cninfo.com.cn 上的第 2013-031 号公告)。

2013 年 6 月 4 日,公司召开第五届董事会第十二次会议,审议通过了《关于筹划收购资产重大事项的议案》,同意公司筹划收购资产重大事项。公司于 2013 年 6 月 7 日、6 月 19 日、7 月 3 日、7 月 10 日、7 月17 日、7月24日、7月31日、8月7日和8月14日分别披露了《关于重大资产重组进展情况的公告》,6 月 26 日公司发布了《关于收购资产重大项目进展暨延期复牌的公告》(详见《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网 www.cninfo.com.cn)

截至本公告日,公司以及有关各方正在积极推动各项工作,中介机构对重组涉及的资产正在进行审计、评估、尽职调查等工作。根据证监会及深交所的相关规定,公司股票继续停牌,停牌期间,公司至少每五个交易日发布一次相关事项进展情况公告。该事项仍存在不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

贵州信邦制药股份有限公司

董 事 会

二〇一三年八月二十日

证券代码:000788 证券简称:北大医药 公告编号:2013-28号

北大国际医院集团西南合成制药股份有限公司 关于公司国家一类抗癌新药康普瑞汀磷酸二钠临床研究项目获得2012年中央国有资本经营预算资金的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

根据财政部《关于下达教育部2012年中央国有资本经营预算(拨款)的通知》(财企〔2012〕466号)、教育部《关于下达2012年中央国有资本经营预算(拨款)的通知》(教财司预算函〔2012〕347号)、北大国际医院集团西南合成制药股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)的康普瑞汀磷酸二钠临床研究项目“经财政部审核,获得了2012年中央国有资本经营预算资金1,000万元。康普瑞丁磷酸二钠系公司在研的国家一类抗癌新药,目前该药物研发已进入Ⅱ、Ⅲ临床研究阶段,具体详见公司2013年4月15日于巨潮资讯网披露的《关于签署康普瑞汀磷酸二钠(CA4P)Ⅱ期临床试验合作研发协议暨关联交易的公告》(2013-18号)。

截止公告之日,上述专项资金1,000万元已转入公司资金账户。公司依据《企业会计准则》及相关规定将上述专项资金计入资本公积,该专项资金的获得不会影响公司本年度的经营业绩,具体会计处理最终以会计师年度审计确认后的结果为准。

特此公告。

北大国际医院集团西南合成制药股份有限公司董事会

二〇一三年八月二十日

证券代码:600260 证券简称:凯乐科技 编号:临2013—024

湖北凯乐科技股份有限公司 关于控股子公司获准发行中小企业私募债券的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

日前,公司控股子公司湖北黄山头酒业有限公司(以下简称:黄山头)收到上海证券交易所出具的《接受中小企业私募债券备案通知书》(上证债备字〔2013〕66号,以下简称:备案通知书),决定接受黄山头2013年中小企业私募债券在本所备案”。备案通知书中明确黄山头本次备案发行的中小企业私募债券的备案金额为25000万元,由金元证券股份有限公司承销;备案通知书印发日期为2013年8月16日,黄山头将在备案通知书出具之日起6个月内完成发行,备案通知书自出具之日起6个月后自动失效。

特此公告

湖北凯乐科技股份有限公司

董事会

二〇一三年八月二十日

证券代码:002153 证券简称:石基信息 编号:2013-38

关于北京中长石基信息技术股份有限公司收到《中国证监会行政许可申请受理通知书》的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

北京中长石基信息技术股份有限公司(以下简称“公司”)于2013年8月20日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2013年8月19日下发的《中国证监会行政许可申请受理通知书》(131099号)。中国证监会依法对公司提交的《北京中长石基信息技术股份有限公司重大资产重组》行政许可申请材料进行了审查,认为该申请材料齐全,符合法定形式,决定对该行政许可申请予以受理。

公司董事会将根据中国证监会审批情况,及时履行信息披露义务。

公司本次重大资产重组尚需经中国证监会核准,能否获得中国证监会的核准尚存在不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

北京中长石基信息技术股份有限公司

董 事 会

2013年8月20日

证券代码:000697 证券简称:炼石有色 公告编号:2013-034

陕西炼石有色资源股份有限公司 关于公司股东股权质押变更情况的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2013年8月20日,本公司接到股东上海中路(集团)有限公司(以下简称:“上海中路”)通知:上海中路于2013年8月19日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了解除证券质押登记手续,将其于2012年7月20日质押给中国民生银行股份有限公司上海分行的本公司54,020,000股(占公司股份总数的11.23%)股权解除了质押。

同日,上海中路在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理了证券质押登记手续,将其持有的本公司54,020,000股(占公司股份总数的11.23%)股权分两笔(各27,010,000股)质押给中国民生银行股份有限公司上海分行,质押期限为二年。

截止本公告签发日,上海中路持有本公司股份54,020,000股,股份性质为流通受限股份,占本公司股份总数的11.23%。其中累计质押54,020,000股,占本公司股份总数的11.23%。

特此公告。

陕西炼石有色资源股份有限公司董事会

二〇一三年八月二十日

股票代码:600483 股票简称:福建南纺 公告编号:2013-016

福建南纺股份有限公司 关于股票继续停牌暨重大事项进展公 告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

2013年7月31日公司发布了《重大事项停牌公告》,披露公司控股股东福建天成集团有限公司拟筹划与本公司相关的重大事项,公司股票按相关规定自2013年7月31日起停牌。8月7日、8月14日公司披露了《关于股票继续停牌暨重大事项进展公告》,公司股票自2013年8月7日起继续停牌。

2013年8月20日公司接到控股股东福建天成集团有限公司《关于对福建南纺股份有限公司进行重大事项筹划的函》(天成〔2013〕5号),目前处于尽职调查的最后阶段。鉴于该事项存在重大不确定性,为保证公平信息披露,维护投资