华夏回报证券投资基金第五十七次分红公告

公告送出日期:2014年12月17日

1公告基本信息

基金名称	华夏回报证券投资基金	
基金简称	华夏回报混合	
基金主代码	002001	
基金合同生效日	2003年9月5日	
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国银行股份有限公司	
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《华夏回报证券投资基金基金合同》、《华夏回报证券投资基金招募说明书(更新)》	
收益分配基准日	2014年12月12日	
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值(单位:人民币元)	1.327
	基准日基金可供分配利润(单位:人民币元)	198,569,483.80
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额(单位:人民币元)	–
本次分红方案(单位:元/10份基金份额)	0.275	
有关年度分红次数的说明	本次分红为2014年度的第7次分红。	

2.与分红相关的其他信息

权益登记日	2014年12月22日
除息日	2014年12月22日
现金红利发放日	2014年12月23日
分红对象	权益登记日在本公司登记在册的本基金全体份额持有人。
红利再投资相关事项的说明	选择红利再投资的投资者其现金红利转换为基金份额的基金份额净值(NAV)确定日为2014年12月22日,该部分基金份额将于2014年12月23日直接计入其基金账户,投资者可自2014年12月24日起查询、赎回。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局的财税[2002]128号《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》及财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,基金向投资者分配的基金利润,暂不征收所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次分红免收分红手续费和红利再投资费用。

注:选择现金红利方式的投资者的红利款将于2014年12月23日自基金托管账户划出。

3其他需要提示的事项

3.1权益登记日申购的基金份额不享有本次分红权益,赎回的基金份额享有本次分红权益。

3.2投资者通过任一销售机构按基金交易代码提交的分红方式变更申请,只对投资者在该销售机构指定交易账户下的基金份额有效,并不改变投资者在该销售机构其他交易账户或其他销售机构基金份额的分红方式。如投资者希望变更该销售机构其他交易账户或其他销售机构基金份额的分红方式,需按基金交易代码通过各销售机构交易账户逐一提交变更分红方式的业务申请。

3.3投资者可通过本公司网站或客户服务电话查询分红方式是否正确,如不正确或希望变更分红方式的,请于权益登记日之前(不含权益登记日)到销售网点或通过电子交易平台办理变更手续。本次分红方式将以投资者在权益登记日之前(不含权益登记日)最后一次选择的分红方式为准。

3.4销售机构及咨询方式

	销售机构名称	网址	客户服务电话
1	华夏基金管理有限公司	www.ChinaAMC.com	400-818-6666
2	中国工商银行股份有限公司	www.icbc.com.cn	95588
3	中国农业银行股份有限公司	www.abchina.com	95599
4	中国银行股份有限公司	www.boc.cn	95566
5	中国建设银行股份有限公司	www.ccb.com	95533
6	交通银行股份有限公司	www.bankcomm.com	95559
7	招商银行股份有限公司	www.cmbchina.com	95555
8	中信银行股份有限公司	bank.ecitic.com	95558
9	上海浦东发展银行股份有限公司	www.spdb.com.cn	95528
10	兴业银行股份有限公司	www.cib.com.cn	95561
11	中国光大银行股份有限公司	www.cebbank.com	95595
12	中国民生银行股份有限公司	www.cmbc.com.cn	95568
13	中国邮政储蓄银行股份有限公司	www.psbc.com	95580
14	北京银行股份有限公司	www.bankofbeijing.com.cn	95526
15	华夏银行股份有限公司	www.hxb.com.cn	95577
16	上海银行股份有限公司	www.bankofshanghai.com	021-962888
17	广发银行股份有限公司	www.gdb.com.cn	400-803-8003
18	平安银行股份有限公司	bank.pingan.com	95511-3
19	宁波银行股份有限公司	www.nbcb.cn	962528(北京、上海)、96528(其他地区)
20	上海农村商业银行股份有限公司	www.shrcb.com	021-962999
21	北京农村商业银行股份有限公司	www.bjrcb.com	96198
22	青岛银行股份有限公司	www.qdccb.com	96588(青岛),400-669-6588(全国)
23	徽商银行股份有限公司	www.hsbank.com.cn	400-889-6588
24	浙商银行股份有限公司	www.czbank.com	95527
25	东莞银行股份有限公司	www.dongguanbank.cn	0769-96228
26	杭州银行股份有限公司	www.hzbank.com.cn	400-888-8508
27	南京银行股份有限公司	www.njcb.com.cn	400-889-6400
28	临商银行股份有限公司	www.lsbchina.com	400-699-6588
29	温州银行股份有限公司	www.wzbank.cn	96699(浙江和上海地区),0577-96699(其他地区)
30	汉口银行股份有限公司	www.hkbchina.com	96558(武汉),400-609-6558(全国)
31	江苏银行股份有限公司	www.jsbchina.cn	96098,400-869-6098
32	洛阳银行股份有限公司	www.bankofluoyang.com.cn	0379-96699
33	乌鲁木齐市商业银行股份有限公司	www.uccb.com.cn	0991-96518
34	烟台银行股份有限公司	www.yantaibank.net	400-831-1777
35	大连银行股份有限公司	www.bankofdl.com	400-664-0099
36	河北银行股份有限公司	www.hebbank.com	400-612-9999
37	包商银行股份有限公司	www.bsb.com.cn	96016(内蒙古、北京)、967210(宁波、深圳)、028-65558555(成都)
38	厦门银行股份有限公司	www.xmccb.com	400-858-8888
39	广州农村商业银行股份有限公司	www.grcbank.com	961111
40	吉林银行股份有限公司	www.jlbank.com.cn	400-889-6666
41	恒生银行(中国)有限公司	www.hangseng.com.cn	800-830-8008,400-830-8008
42	天相投资顾问有限公司	www.txsec.com	010-66045678
43	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	t.jrj.com	400-850-7771
44	和讯信息科技有限公司	licaike.hexun.com	400-920-0022,021-20835588
45	上海天天基金销售有限公司	www.1234567.com.cn	400-181-8188
46	上海好买基金销售有限公司	www.ehowbuy.com	400-700-9665
47	杭州数米基金销售有限公司	www.fund123.cn	400-076-6123
48	浙江同花顺基金销售有限公司	www.5ifund.com	400-877-3772
49	万银财富(北京)基金销售有限公司	www.wy-fund.com	400-081-6655
50	深圳腾元基金销售有限公司	www.tenyuanfund.com	400-687-7899
51	深圳宜投基金销售有限公司	www.yitifund.com	400-895-5811
52	北京钱袋财富投资管理有限公司	www.niuji.net	400-678-5095
53	上海久富财富管理有限公司	www.jfcfa.com	400-021-9898
54	国泰君安证券股份有限公司	www.gtja.com	400-888-8666
55	中信建投证券股份有限公司	www.csc.com.cn	400-888-8108
56	国信证券股份有限公司	www.guosen.com.cn	95536
57	招商证券股份有限公司	www.newone.com.cn	400-888-8111,95565
58	广发证券股份有限公司	www.gf.com.cn	95575或致电各地营业网点
59	中信证券股份有限公司	www.cs.ecitic.com	95548
60	中国银河证券股份有限公司	www.chinastock.com.cn	400-888-8888
61	海通证券股份有限公司	www.htsec.com	021-962503,400-888-8001或按打各城市营业网点咨询电话
62	申银万国证券股份有限公司	www.sywg.com	95523,400-889-5523
63	兴业证券股份有限公司	www.xyzq.com.cn	95562
64	长江证券股份有限公司	www.95579.com	95579,400-888-8999
65	安信证券股份有限公司	www.essence.com.cn	400-800-1001
66	西南证券股份有限公司	www.swsc.com.cn	400-809-6096
67	中信证券(浙江)有限责任公司	www.bigsun.com.cn	95548
68	湘财证券股份有限公司	www.xcsc.com	400-888-1551
69	万联证券有限责任公司	www.wlzq.com.cn	400-888-8133
70	国元证券股份有限公司	www.gyzq.com.cn	95578
71	渤海证券股份有限公司	www.bhzq.com	400-651-5988
72	华泰证券股份有限公司	www.htsc.com.cn	95597
73	山西证券股份有限公司	www.i618.com.cn	400-666-1618
74	中信证券(山东)有限责任公司	www.citicssd.com	95548
75	东兴证券股份有限公司	www.dxzq.net.cn	400-888-8993
76	东吴证券股份有限公司	www.dwzq.com.cn	0512-33396288
77	信达证券股份有限公司	www.cindasc.com	400-800-8899
78	东方证券股份有限公司	www.dfzq.com.cn	95503
79	方正证券股份有限公司	www.foundersc.com	95571
80	长城证券有限责任公司	www.cgws.com	400-666-6888,0755-33680000
81	光大证券股份有限公司	www.ebscn.com	95525,400-888-8788
82	广州证券股份有限公司	www.gzs.com.cn	020-961303
83	东北证券股份有限公司	www.nesc.cn	400-600-0686
84	南京证券股份有限公司	www.njzq.com.cn	400-828-5888
85	上海证券有限责任公司	www.962518.com	021-962518
86	新时代证券有限责任公司	www.xsdzq.cn	400-698-9898
87	大同证券经纪有限责任公司	www.dtsbc.com.cn	400-712-1212
88	国联证券股份有限公司	www.ghc.com.cn	400-888-5288
89	浙商证券股份有限公司	www.stocke.com.cn	0571-967777
90	平安证券有限责任公司	www.pingan.com	400-881-6168
91	华安证券股份有限公司	www.hazq.com	0551-96518,400-809-6518
92	国海证券股份有限公司	www.ghzq.com.cn	95563
93	财富证券有限责任公司	www.cfzq.com	0731-4403319
94	东莞证券有限责任公司	www.dgzq.com.cn	0769-961130
95	中原证券股份有限公司	www.ccnew.com	0371-967218,400-813-9666
96	国都证券有限责任公司	www.guodu.com	400-818-8118
97	东海证券股份有限公司	www.longone.com.cn	95531,400-888-8588
98	中银国际证券有限责任公司	www.bocichina.com.cn	400-620-8888
99	恒泰证券股份有限公司	www.cnht.com.cn	0471-4961259
100	国盛证券有限责任公司	www.gsstock.com	0791-6285337
101	华西证券股份有限公司	www.hx168.com.cn	400-888-8818
102	宏源证券股份有限公司	www.hysec.com	400-800-0562
103	齐鲁证券有限公司	www.qlzq.com.cn	95538
104	世纪证券有限责任公司	www.csco.com.cn	0755-83199511
105	第一创业证券股份有限公司	www.firstcapital.com.cn	400-888-1888
106	金元证券股份有限公司	www.jyzq.cn	400-888-8228
107	中航证券有限公司	www.avicsec.com	400-886-6567
108	华林证券有限责任公司	www.chinalins.com	400-188-3888
109	德邦证券有限责任公司	www.tebon.com.cn	400-888-8128
110	西部证券股份有限公司	www.westsecu.com	95582
111	华福证券有限责任公司	www.hfzq.com.cn	0591-96326
112	华龙证券有限责任公司	www.hlzqgs.com	0931-4890619,4890618,4890100
113	中国国际金融有限公司	www.cicc.com.cn	010-65051166
114	财通证券股份有限公司	www.ctsec.com	0571-96336
115	华鑫证券有限责任公司	www.cfsc.com.cn	021-32109999,029-68918888,400-109-9918
116	瑞银证券有限责任公司	www.ubssecurities.com	400-887-8827
117	中国中投证券有限责任公司	www.china-invs.cn	400-600-8008,95532
118	中山证券有限责任公司	www.zszq.com	400-102-2011
119	西藏同信证券有限责任公司	www.xzsec.com	400-881-1177
120	日信证券有限责任公司	www.rxzq.com.cn	010-88086830
121	江海证券有限公司	www.jhzq.com.cn	400-666-2288
122	国金证券股份有限公司	www.gjzq.com.cn	95105111(四川地区)、400-660-0109(全国)
123	中国民族证券有限责任公司	www.e5618.com	400-889-5618
124	华宝证券有限责任公司	www.cnhbstock.com	400-820-9898
125	厦门证券有限公司	www.xmzq.cn	0592-5163588
126	爱建证券有限责任公司	www.ajzq.com	021-63340678
127	华融证券股份有限公司	www.hrsec.com.cn	010-58568118
128	天风证券股份有限公司	www.tfzq.com	028-86711410,027-87618882
129	安信证券有限责任公司	www.hxzq.cn	400-836-6366

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇一四年十二月十七日

华夏基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告

鉴于“12磐新城”(代码122715)2014年12月16日在交易所的收盘价异常,根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求,经与相关托管银行协商一致,自2014年12月16日起,华夏基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下基金持有的“12磐新城”采用估值技术计算的公允价格进行估值。自该债券当日交易所收盘价能体现公允价值特征之日起,本公司将对其恢复按交易所收盘价进行估值,届时不再另行公告。

本公司将定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇一四年十二月十七日

证券代码:000688　　证券简称:建新矿业　　公告编号:2014-078号

建新矿业股份有限责任公司关于召开2014年第四次临时股东大会的提示性公告

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

建新矿业股份有限责任公司(以下简称“公司”)第九届董事会第十四次会议决定在2014年12月22日召开公司2014年第四次临时股东大会,公司于2014年12月5日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及巨潮资讯网上刊登了《关于召开2014年第四次临时股东大会的通知》,根据有关规定,公司现就召开2014第四次临时股东大会的有关事项再次作如下提示性公告:

一、召开会议的基本情况

(一)召开时间:

现场会议召开时间:2014年12月22日(星期一)下午14:30

网络投票时间:2014年12月21日-2014年12月22日

其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2014年12月22日9:30至11:30,13:00至15:00;通过深圳证券交易所互联网投票的具体时间为:2014年12月21日15:00至2014年12月22日15:00期间的任意时间。

(二)股权登记日:2014年12月16日(星期二)

(三)现场会议召开地点:北京市丰台区南四环西路188号16区19号楼3层

(四)召集人:公司董事会

(五)会议召开的合法合规性情况:本次会议的召集程序符合有关法律、法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

(六)召开方式:采用现场投票及网络投票相结合的方式。

(七)投票方式:公司股东只能选择现场投票、深圳证券交易所交易系统投票、深圳证券交易所互联网系统投票中的一种投票方式。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。如同一表决权通过现场、交易系统或互联网系统重复进行表决的,以第一次投票表决结果为准。

(八)出席对象:

1、截至2014年12月16日(星期二)15:00交易结束后在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东或其委托代理人(授权委托书附后);

2、本公司董事、监事及高级管理人员;

3、公司聘请的律师和董事会邀请的嘉宾。

二、会议审议事项

(一)议案名称:

1、审议《关于公司收购建新集团持有的中都矿产100%股权的关联交易议案》;

2、审议《关于公司购买建新集团北京部分房产的关联交易议案》;

3、审议《关于修订<公司章程>部分条款的议案》;

4、审议《关于修订<对外担保制度>的议案》;

5、审议《关于修订<关联交易决策制度>的议案》;

6、审议《关于修订<对外投资管理制度>的议案》;

(二)披露情况:

关于召开2014年第四次临时股东大会所有提案内容详见公司于2014年12月5日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn上的《建新矿业股份有限责任公司第九届董事会第十四次会议决议公告》等相关公告。

(三)特别强调事项:

1、全体股东既可参与现场投票,也可通过互联网参加网络投票。

2、议案一《关于公司收购建新集团持有的中都矿产100%股权的关联交易议案》、议案二《关于公司购买建新集团北京部分房产的关联交易议案》关联股东建新集团需回避表决;议案三《关于修订<公司章程>部分条款的议案》系特别决议,需经出席会议股东所持表决权的三分之二以上通过方为有效;

三、现场股东大会会议登记方法

(一)登记方式:

1、法人股东应持有营业执照复印件、法定代表人证明书或法定代表人依法出具的授权委托书、股东账户卡、有效持股凭证、法定代表人或代理人本人身份证进行登记。

2、个人股东应持有本人身份证、股东账户卡、有效持股凭证进行登记,委托出席者应持有授权委托书、委托人及代理人身份证、委托人股东账户卡、委托人有效持股凭证进行登记。

3、异地股东可以在登记截止前用信函或传真方式进行登记,不接受电话登记。

(二)登记时间:2014年12月18日及2014年12月19日上午9:00-12:00、下午13:00-17:00;

(三)登记地点:公司董事会办公室

信函登记地址:公司董事会办公室,信函上请注明“股东大会”字样;

通讯地址:重庆市北部新区新南路164号水晶国际808室

邮编:401147 传真:023-63067268

四、参与网络投票的股东的身份认证与投票程序

(一)采用交易系统投票的投票程序

1、本次临时股东大会通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2014年12月22日9:30至11:30、13:00至15:00期间的任意时间,投票程序比照深圳证券交易所新股申购业务操作。

2、投票代码:360688,投票简称:建新投票

3、股东投票的具体程序为:

(1)买卖方向为买入投票;

(2)在“委托价格”项下填报本次临时股东大会的申报价格,具体如下表:

议　　案	对应申报价(元)
1、审议《关于公司收购建新集团持有的中都矿产100%股权的关联交易议案》;	1.00
2、审议《关于公司购买建新集团北京部分房产的关联交易议案》;	2.00
3、审议《关于修订<公司章程>部分条款的议案》;	3.00
4、审议《关于修订<对外担保制度>的议案》;	4.00
5、审议《关于修订<关联交易决策制度>的议案》;	5.00
6、审议《关于修订<对外投资管理制度>的议案》;	6.00

(3)在“委托股数”项下填报表决意见,1股代表“同意”,2股代表“反对”,3股代表“弃权”,如下表:

表决意见种类对应的申报股数

表决意见种类	对应的申报股数
同意	1股
反对	2股
弃权	3股

(4)对同一表决事项的投票只能申报一次,不能撤单,多次申报的,以第一次申报为准;

(5)不符合上述规定的申报无效,深圳证券交易所交易系统作自动撤单处理。

(二)采用互联网投票的身份认证与投票程序

1、股东获取身份认证的具体流程按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务实施细则》的规定,股东可以采用服务密码或数字证书的方式进行身份认证。

(1)申请服务密码的流程

登陆网址:http://wltp.cninfo.com.cn 的密码服务专区注册;填写“姓名”、“证券账户号”等相关信息并设置服务密码,如申请成功,系统会返回一个4位数字的激活校验码。

(2)激活服务密码

股东通过深交所交易系统比照买入股票的方式,凭借“激活校验码”激活服务密码。

如服务密码激活指令上午11:30前发出的,当日下午13:00即可使用;如服务密码激活指令上午11:30后发出的,次日方可使用。

服务密码激活后长期有效,在参加其他网络投票时不必重新激活。密码激活后如遗失可通过交易系统挂失,挂失后可重新申请,挂失方法与激活方法类似。

申请数字证书的,可向深圳证券信息公司或其委托的代理发证机构申请。

申请数字证书咨询电话:0755-83991880/25918485/25918486

申请数字证书咨询电子邮件地址:xuningyan@p5w.net

网络投票业务咨询电话:0755-83991022/83990728/83991192

2、股东根据获取的服务密码或数字证书可登录网址http://wltp.cninfo.com.cn的互联网投票系统进行投票。

A)登录http://wltp.cninfo.com.cn,在“上市公司股东大会列表”选择“建新矿业股份有限责任公司2014年第四次临时股东大会投票”;

B)进入后点击“投票登录”,选择“用户名密码登陆”,输入您的“证券账户号”和“服务密码”;已申领数字证书的投资者可选择CA证书登录;

C)进入后点击“投票表决”,根据网页提示进行相应操作;

D)确认并发送投票结果。

3、投资者进行投票的时间

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为:2014年12月21日15:00至2014年12月22日15:00期间的任意时间。

五、投票注意事项

(一)同一股份只能选择现场投票、网络投票中的任意一种表决方式,不能重复投票;如出现重复投票的,以第一次投票结果为准。

(二)如需查询投票结果,请于投票当日下午18:00后登陆深圳证券交易所互联网投票系统(http://wltp.cninfo.com.cn),点击“投票查询”功能,可以查看个人网络投票结果,或在投票委托的证券公司营业部查询。

六、单独计票提示

根据《上市公司股东大会议事规则(2014修订)》要求,本次临时股东大会议案一《关于公司收购建新集团持有的中都矿产100%股权的关联交易议案》、议案二《关于公司购买建新集团北京部分房产的关联交易议案》,公司将对中小投资者的表决实施单独计票【中小投资者指持股5%(不含5%)以下股东】。

七、其他事项

1、会议咨询:公司董事会办公室

联系人:王世鹏、方燕

联系电话:023-63067268

2、与会股东或代理人交通、住宿等费用自理。

特此公告

建新矿业股份有限责任公司董事会

二O一四年十二月十六日

附:授权委托书

建新矿业股份有限责任公司2014年第四次临时股东大会授权委托书

兹委托　　(先生/女士)代表本人(本单位)出席建新矿业股份有限责任公司2014年第四次临时股东大会,并代表本人对会议审议的各项议案按本授权委托书的指示行使投票,并代为签署本次会议需要签署的相关文件。

本公司、本人对本次股东大会议案的表决意见如下:

议　　案	同意	反对	弃权	回避
1、审议《关于公司收购建新集团持有的中都矿产100%股权的关联交易议案》;				
2、审议《关于公司购买建新集团北京部分房产的关联交易议案》;				
3、审议《关于修订<公司章程>部分条款的议案》;				
4、审议《关于修订<对外担保制度>的议案》;				
5、审议《关于修订<关联交易决策制度>的议案》;				
6、审议《关于修订<对外投资管理制度>的议案》;				

委托人(或单位)签名或盖章:　　身份证号码(或营业执照号码):

持股数:　　股东帐号:

受托人签名:　　身份证号码:

受托期限:　　委托日期:

附注:

1、如欲投票同意议案,请在“同意”栏内相应地方填上“√”;如欲投票反对议案,请在“反对”栏内相应地方填上“√”,如欲投票“弃权”议案,请在“弃权”栏内相应地方填上“√”。

2、授权委托书剪报、复印或按以上格式自制均有效;单位委托须加盖单位公章。

(上接B029版)

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22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、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:徐艳、汤骏

业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金的名称:汇添富消费行业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

本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,精选消费行业的优质上市公司,结合市场脉络,做中长期布局,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的中长期稳健增值。

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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、债券回购等)、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款(包括定期存款及协议存款)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。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%—95%,基金以消费行业上市公司为股票主要投资对象,投资于消费行业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%;其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。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%;基金持有单只中小企业私募债,其市值不得超过基金资产净值的10%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,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%。

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消费行业中商业模式独特、竞争优势明显,具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。

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(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,按照本基金管理人投资管理制度要求和股票投资限制,针对沪深两市消费行业的全部上市公司,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、涉及重大案件和诉讼的股票等)。

其次,本基金管理人采取定性分析的方法,结合消费行业的特点,分别从内生增长和外延并购两方面进行深入分析,评估备选公司的行业特征、经营状况、财务数据、业绩驱动因素等,从中选择具有核心竞争优势和长期持续增长模式的公司。具体如下:

① 内生增长分析:即通过分析公司的商业模式、竞争优势、行业前景等方面来选择业绩增速最快、持续性更强的公司。

1)商业模式——从价值主张、目标客户、营销方式、管理体制、组织结构、业务流程等方面研判备选公司的增长持续性、利润弹性以及扩张潜力,从中寻找商业模式独特、能够改变传统格局从而带来爆发增长、或者通过规模效应可以形成强大壁垒的公司。

2)竞争优势——从品牌优势、渠道优势、管理团队等方面研判备选公司是否具有从行业中脱颖而出、成为行业领袖的能力。

3)行业前景——从行业规模、行业景气周期、增长速度、竞争格局等方面分析备选公司所处的行业环境是否有利于公司快速、稳定成长。

② 外延增长分析:即通过选择具有并购能力、能够通过整体上市、并购重组等方式实现经营规模扩张的公司,以及有被并购价值、资产或品牌价值明显、被并购后能够出现经营改善、利润水平大幅提高的公司。

1)整体上市和并购重组——发掘消费行业中可能发生诸如整体上市、并购(包括横向并购、产业链上下游之间的纵向并购、横向纵向结合或无直接关系的混合并购)、战略参股(指上市公司引进具有高级经营管理经验或财务管理能力的外资战略伙伴)、剥离(指为集中力量做大做强主业而将企业的一部分次要或亏损经营或无关投资性资产出售给第三方)等事件的备选公司,研判其是否可以借机实现公司经营规模扩张、业绩增长和估值溢价。

2)被并购价值——通过分析备选公司的资产价值、品牌价值、股东结构等因素,寻找由于各种外部原因,企业价值被明显低估,可能被第三方兼并收购的备选公司,研判其是否可能在被并购后出现经营状况和盈利能力的大幅改善,实现业绩增长和估值回升。

然后,针对筛选出的具有核心竞争优势和长期持续增长模式的公司,本基金管理人采取定量分析的方法,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,给出股票综合评级,从中选择估值水平相对合理的公司,组成本基金的股票库。

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、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、合理谨慎地评估、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,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。

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

6、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。

7、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其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、投资决策程序

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,设立了投资研究部和金融工程部,策略分析师、行业分析师、金融工程分析师和基金经理立足本职工作,充分发挥主观能动性,