(上接B023版)

110) 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/
111) 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
112) 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
113) 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
114) 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
115) 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/
116) 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
117) 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/
118) 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
119) 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
120) 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:罗昶安
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
121) 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
122) 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.haofuns.com
123) 中信建投期货有限公司
注册地址:渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C
办公地址:渝中区中山三路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
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、李永波
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:阎育化、汤骏
业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富逆向投资股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金主要采用逆向投资策略进行主动投资管理,在科学严格的投资风险管理前提下,谋求基金资产长期稳健回报。

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(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或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)。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%。

本基金管理人将以下五类股票定义为本基金所关注的未被市场主流认同的股票,具体包括:市场阶段性关注度较低的股票,涉及重大突发事件且为市场过度反映的股票,景气存在复苏可能但尚未被市场充分发掘的股票,可能或正处于并购重组但市场存在分歧的股票、治理结构有望改善但市场预期有限的股票。本基金投资于未被市场主流认同的股票的资产占股票资产的比例不低于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未被市场主流认同的价值被低估的股票以努力获取超额收益。

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"的方法进行个股精选。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,在沪深两市全部股票中,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等),筛选得到的股票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,本基金管理人深入研究公司基本面,主要选择以下五类未被市场主流认同的股票,组成本基金的精选股票库。具体说明如下:

(1)市场阶段性关注度较低的股票。

由于政策环境、证券市场风格转换、卖方研究跟踪较少等原因,市场阶段性关注度较低的股票的成交相对不活跃,其绝对或相对估值可能在一段时期内低于历史平均水平,股价往往未能充分反映其内在价值。

本基金管理人采用市场关注度排名、主要卖方一定时期内跟踪报告数量、交易量、换手率、股价变动幅度等指标来评估股票的市场关注度,选择市场阶段性关注度较低的股票。

(2)涉及重大突发事件且为市场过度反映的股票。

重大突发事件,包括但不限于自然灾害、重大诉讼、核心人员伤亡等,往往在短期内会对相关上市公司造成较大冲击。大部分投资者可能因为更加关注重大突发事件对公司的短期影响,而忽视公司的中长期价值;或者对重大突发事件影响的评估过于悲观或过于乐观,导致公司股价出现过度反映,从而产生投资机会。

本基金管理人在重大突发事件发生后密切跟踪相关上市公司,评估公司基本面变化与市场价格波动的合理性,选择价格过度偏离其合理价值的股票。

(3)景气存在复苏可能但尚未被市场充分发掘的股票。

由于供求关系、市场竞争、产业政策等因素,上市公司经营环境处于不利的状态,盈利能力低于历史合理水平。在经营环境等因素出现转机之后,企业景气存在复苏可能。但大部分投资者可能因为担心判断失误或过度自信等原因,未充分识别景气复苏的时点及程度,导致部分股票的价格滞后于实业本体的变化。

本基金管理人在宏观研究的基础上,分析上下游产业链和相关政策的变化,考察企业的生产成本、产销总量、产品价格、库存、资金、盈利、用工、投资及其他综合生产经营情况等因素,在景气低迷但有望复苏的上市公司中选择尚未被市场充分发掘的股票。

(4)可能或正处于并购重组但市场存在分歧的股票。

并购重组是指两个以上公司合并、组建新公司或相互参股等情形。通过并购重组,上市公司可在管理、资金、产品研发、质量控制、营销能力等方面增强竞争力,改善经营业绩,提升公司价值。由于部分公司并购重组进程的曲折性和复杂性,不确定性风险在一定时期内可能被夸大,大部分投资者因此在短期内回避相应股票的投资,从而存在投资机会。

本基金管理人深入研究国家产业政策导向、公司股权变更和信息披露等重要线索,在可能或正处于并购重组的上市公司中寻找市场存在分歧的股票。

(5)治理结构有望改善但市场预期有限的股票。

治理结构不完善可能导致公司盈利能力明显低于行业平均水平,使得公司估值被市场压制。当治理结构有望改善时,公司将向权责分明、各司其职、激励约束并存的有利氛围发展,公司整体竞争力将得到有效提升。但是由于部分公司的历史原因或其他影响因素,大部分投资者可能因为担心判断失误或过度自信等原因,未正确认识这些公司治理结构改善的前景,股价未充分反映其基本面的良性变化,从而存在投资机会。

本基金管理人将从信息披露、重要股东状况、激励约束机制等三方面衡量公司的治理结构,选择存在改善可能但市场预期有限的上市公司。

然后,在精选股票库的基础上,本基金管理人将实地调研上市公司,深入了解管理团队、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等基本面信息,根据不同行业特征和市场特征,从内在价值、相对价值、收购价值等方面,灵活运用市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈增长比率(PEG)、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)等指标,选择价值被低估的股票,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,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;行业分析师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、行业分析师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)金融工程部进行全程风险评估和绩效分析。

(三)投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(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)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)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%;

(2)本基金投资于符合《基金合同》定义的未被市场主流认同的股票的资产占股票资产的比例不低于80%;

(3)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%;

(4)本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过该证券的10%;

(5)进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%。债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(6)本基金参与股票发行申购,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;

(7)本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例,遵从法律法规或监管部门的相关规定;

(8)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%;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,不得超过该基金资产净值的10%;本基金管理人管理的全部证券投资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%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过本基金资产净值的20%;

(9)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(10)本基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过本基金资产净值的百分之二;本基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过本基金资产净值的百分之十;经基金管理人和托管人协商,履行适当程序后可对以上比例进行调整;

(11)本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

(12)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

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的投资比例的,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。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

上述投资组合限制条款中,若属法律法规的强制性规定,则当法律法规或监管部门取消上述限制,在履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

九、基金的业绩比较基准

沪深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、沪深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、沪深300指数编和发布有一定的历史,有较高的知名度和市场影响力;

3、沪深300指数是中证指数公司编制并推出的沪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沪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沪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2015年1月20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	524,003,840.20	90.50
	其中:股票	524,003,840.20	90.50
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	50,675,969.82	8.75
7	其他资产	4,342,429.51	0.75
8	合计	579,022,229.53	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	30,003,076.80	5.23
C	制造业	247,861,035.42	43.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	55,792,697.90	9.73
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	44,567,030.08	7.77
J	金融业	89,647,000.00	15.63
K	房地产业	33,291,000.00	5.81
L	租赁和商务服务业	22,842,000.00	3.98
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	524,003,840.20	91.39

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	601318	中国平安	700,000	52,297,000.00	9.12
2	601633	长城汽车	899,702	37,382,618.10	6.52
3	601988	中国银行	9,000,000	37,350,000.00	6.51
4	600305	恒顺醋业	1,999,919	36,318,529.04	6.33
5	000402	金 融 街	2,700,000	33,291,000.00	5.81
6	601699	潞安环能	2,599,920	30,003,076.80	5.23
7	600702	沱牌舍得	1,599,986	29,807,739.18	5.20
8	002589	瑞康医药	870,998	28,159,365.34	4.91
9	000906	物产中拓	1,595,458	27,633,332.56	4.82
10	002018	华信国际	1,925,360	27,263,097.60	4.75

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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	365,748.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,142.68
5	应收申购款	3,967,537.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,342,429.51

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处于转股期的可转换债券。

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	000906	物产中拓	27,633,332.56	4.82	重大资产重组停牌
2	002018	华信国际	27,263,097.60	4.75	重大资产重组停牌

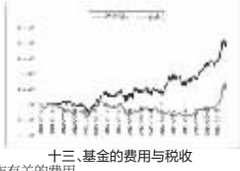
十二、基金的业绩

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)
2012年3月9日(基金合同生效日)至2012年12月31日	0.00%	0.69%	-2.80%	0.96%	2.80%	-0.27%
2013年1月1日至2013年12月31日	18.30%	1.31%	-6.02%	1.12%	24.32%	0.19%
2012年3月9日(基金合同生效日)至2013年12月31日	18.30%	1.07%	-8.47%	1.05%	26.77%	0.02%
2014年1月1日至2014年12月31日	54.09%	1.17%	42.85%	0.97%	11.24%	0.20%
2012年3月9日(基金合同生效日)至2014年12月31日	82.29%	1.11%	30.74%	1.02%	51.55%	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



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、证券账户开户费用和银行账户维护费;

8、基金财产拨划支付的银行费用;

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)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同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,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。

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。

3、上述"(一)基金费用的种类"中3到8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。

(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。

(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。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。

(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:

更新了基金托管业务经营情况。

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、"二十二、其他应披露事项"部分:

更新了2014年9月10日至2015年3月9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
2015年4月18日

证券代码:002135 证券简称:东南网架 公告编号:2015-034

浙江东南网架股份有限公司 关于短期融资券获准注册的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

浙江东南网架股份有限公司(以下简称"公司")于2014年11月14日召开的2014年第三次临时股东大会审议通过了《关于申请发行短期融资券的议案》,具体内容详见本公司于2014年11月15日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上的《2014年第三次临时股东大会决议公告》(公告编号:2014-064)。

根据2014年第三次临时股东大会决议,公司向中国银行间市场交易商协会(以下简称"交易商协会")提交了发行短期融资券注册报告。近日,公司收到了交易商协会下发的《接受注册通知书》(中市协注[2015]CP66号),交易商协会同意接受公司短期融资券注册。《接受注册通知书》中明确,公司本次发行短期融资券注册金额为4亿元,注册额度自通知书发出之日起2年内有效,由中信银行股份有限公司主承销。在注册有效期内可分期发行,首期发行应在注册后2个月内完成,后续发行应提前2个工作日向交易商协会备案。

公司将根据资金需求及市场利率波动情况,在注册有效期内择机发行首期短期融资券,并及时履行相关的信息披露义务。

特此公告。

浙江东南网架股份有限公司
董事会
2015年4月18日

证券代码:002258 股票简称:利尔化学 公告编号:2015-018

利尔化学股份有限公司 关于中国证监会受理公司配股申请的公告

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

利尔化学股份有限公司(以下简称"公司")于2015年4月17日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")于2015年4月15日出具的《中国证监会行政许可申请受理通知书》(150740号)。中国证监会依法对公司提交的《上市公司配股》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。

公司配股事宜能否获得核准仍存在不确定性,公司董事会提醒广大投资者注意投资风险。公司将根据中国证监会审批的进展情况及时履行信息披露义务。

特此公告。

利尔化学股份有限公司
董事会
二○一五年四月十八日

证券代码:002256 证券简称:彩虹精化 公告编号:2015—072

深圳市彩虹精细化工股份有限公司 关于控股股东股权解除质押的公告

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

深圳市彩虹精细化工股份有限公司(以下简称"公司")2015年4月17日接到控股股东深圳市彩虹创业投资集团有限公司(以下简称"彩虹集团")通知,彩虹集团将其持有的原质押给中信银行股份有限公司深圳分行的5,000,000股无限售流通股(该质押事项详见公司2014年4月25日刊登在《证券日报》、《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn上的第2014-031号公告)中的3,500,000股无限售流通股(占公司目前股份总数的1.11%)于2015年4月17日解除了质押,并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质押登记手续。

彩虹集团共持有公司无限售条件流通股122,616,000股,占公司股份总数的38.98%。截止本公告披露日,彩虹集团共质押其持有的公司股份114,100,000股,占公司股份总数的36.27%。

特此公告。

深圳市彩虹精细化工股份有限公司
董 事 会
二〇一五年四月十八日

证券代码:002288 证券简称:超华科技 公告编号:2015-013

广东超华科技股份有限公司 关于闲置募集资金补充流动资金到期归还的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

广东超华科技股份有限公司(以下简称"公司")2014年4月22日召开的第四届董事会第六次会议审议通过了《关于使用部分闲置募集资金暂时补充公司流动资金的议案》,同意公司在保证募集资金投资项目建设的资金需求、保证募集资金投资项目正常进行的前提下,使用部分闲置募集资金人民币5,500万元暂时补充公司流动资金。使用期限为自董事会审议通过之日起不超过12个月,到期归还到募集资金专用账户。详细内容请见公司于2014年4月23日在《证券时报》、《中国证券报》及巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上刊登的《关于使用部分闲置募集资金暂时补充公司流动资金的公告》(公告编号:2014-022)。

截至2015年4月17日,公司已将上述用于暂时补充流动资金的募集资金人民币5,500万元全部归还并转入公司募集资金专用账户。同时,公司已将上述募集资金的归还情况通知了公司的保荐机构及保荐代表人。

特此公告。

广东超华科技股份有限公司
董 事 会
二○一五年四月十七日

证券代码:600375 证券简称:华菱星马 编号:临2015—011

华菱星马汽车(集团)股份有限公司 2015年第一季度业绩预亏公告

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。

一、本期业绩预告情况

1、业绩预告期间:2015年1月1日至2015年3月31日。

2、业绩预告情况:经