(上接B10版)

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 | 0901044 | 09央行票据44 | 5,000,000 | 490,750,000.00 | 3.66 |
| 2 | 0901046 | 09央行票据46 | 5,000,000 | 490,700,000.00 | 3.66 |
| 3 | 010215 | 01国开15 | 3,500,000 | 355,880,000.00 | 2.65 |
| 4 | 090218 | 09国开18 | 3,500,000 | 349,510,000.00 | 2.61 |
| 5 | 090223 | 09国开23 | 3,000,000 | 299,460,000.00 | 2.23 |

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

8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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、处罚的情形。

8.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 9,177,035.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | 110,692,755.23 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 46,341,099.57 |
| 5 | 应收申购款 | 1,074,577.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 167,285,467.75 |

8.4 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。

8.5 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） | 占基金资净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 454,371,954.30 | 3.39 | 重大资产重组 |
| 2 | 600060 | 海信电器 | 90,375,000.00 | 0.67 | 非公开发行流通受限 |

**十三、基金的业绩**

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。

本基金合同生效日为2002年9月13日，财务数据截至日为2010年6月30日。基金合同生效以来各阶段基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2002年度 | -3.18% | 0.23% | -13.76% | 0.87% | 10.58% | -0.64% |
| 2003年度 | 19.97% | 0.58% | -0.92% | 0.82% | 20.89% | -0.24% |
| 2004年度 | -2.37% | 0.97% | -12.21% | 1.02% | 9.84% | -0.05% |
| 2005年度 | 6.70% | 1.01% | -10.67% | 1.09% | 17.37% | -0.08% |
| 2006年度 | 114.00% | 1.26% | 59.26% | 1.09% | 54.74% | 0.17% |
| 2007年度 | 116.27% | 1.85% | 114.93% | 1.70% | 1.34% | 0.15% |
| 2008年度 | -44.85% | 1.53% | -50.30% | 2.29% | 5.45% | -0.76% |
| 2009年度 | 48.92% | 1.58% | 74.03% | 1.50% | -25.11% | 0.08% |
| 2010年上半年 | -17.15% | 1.03% | -21.30% | 1.20% | 4.15% | -0.17% |

注：截至2009年12月31日，本基金的业绩比较基准为：国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%；2010年1月1日起至今，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%。

**十四、基金份额的申购、赎回与转换**

（一）基金投资者范围

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规及有关规定禁止购买者除外）和合格的境外机构投资者。

（二）申购、赎回与转换的办理场所

1、本公司的直销机构和公司网站（详见本招募说明书第五节）。

2、本公司委托的代销机构的营业网点（详见本招募说明书第五节）。

本公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

（三）申购、赎回与转换的开放日及时间

1、申购、赎回与转换的办理时间

本基金为投资者办理申购、赎回与转换等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。目前业务办理时间为上午9:30至11:30，下午13:00至15:00。基金管理人可以根据实际情况调整业务办理时间。

投资者在本招募说明书约定之外的日期和时间提出申购、赎回与转换申请的，其基金份额申购、赎回与转换价格为下次办理基金份额申购、赎回与转换时间所在开放日的价格；

2、申购开始日

本基金合同生效后，开始接受申购的时间为2002年10月15日。

3、赎回开始日

本基金合同生效后，开始接受赎回的时间为2002年11月1日。

4、转换开始日

自2006年11月21日起，开通转换业务。目前该业务适用于本基金与本基金管理人管理的融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金和融通易支付货币基金之间的基金转换业务。

（四）申购与赎回的原则

1、"未知价"原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、在限制申购的情况下，申购费用按确认的申购金额所对应的申购费率计算。

4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间（目前为15:00）以前撤销。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可根据基金运作的实际情况更改上述原则，并最迟于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（五）申购、赎回与转换的限制

1、投资者在代销网点和网上直销的每次最低申购金额为1,000元人民币（含申购费，定期定额申购每次最低金额为100元人民币）；在直销机构的直销柜台单笔最低申购金额为10万元人民币（含申购费）。

2、本基金不规定赎回的最低份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。

3、投资者每次最低转换份额为1000份基金份额。

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购最低金额或赎回与转换最低份额的限制，最迟在开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（六）申购、赎回与转换的程序

1、申购、赎回与转换申请的提出

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回与转换的申请。

2、申购、赎回与转换申请的确认

申请当日（T日）在规定时间内受理的申请，正常情况下投资者可在T+2日通过本公司客户服务电话或其办理业务的销售网点查询确认情况。

3、申购与赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请确认后，赎回款项将在T+5日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及本招募说明书有关规定处理。

（七）本基金的申购费与赎回费

1、申购费率

①本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

②本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，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。费率表如下：

| 申购金额（含申购费） | 费率 |
|---|---|
| 100万元以下 | 1.50% |
| 100万元（含）—1,000万元 | 1.20% |
| 1,000万元（含）—1亿元（含） | 1.00% |
| 超过1亿元以上部分 | 0.00% |

③本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

| 持有时间（T） | 后端申购费率 |
|---|---|
| T<1年 | 1.60% |
| 1年≤T<2年 | 1.20% |
| 2年≤T<3年 | 0.80% |
| 3年≤T<4年 | 0.40% |
| T≥4年 | 0.00% |

2、赎回费按照赎回总金额的0.50%收取，最低赎回费为5元。赎回费用由赎回人承担，赎回费的40%归基金财产。

3、基金管理人可以调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在招募说明书（更新）中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（八）申购份数、赎回金额与转入份数的计算方式

1、申购份数的计算

净申购金额以四舍五入的方法保留小数点后两位，余额归基金财产；基金份额份额数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

①前端收费模式

如果投资者选择缴纳前端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

②如果投资者选择缴纳后端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

申购份数=申购金额/T日基金份额净值

例一：假定T日的基金份额净值为1.2000元，三笔申购金额分别为5,000元、100万元和1,000万元。如果投资者选择缴纳前端申购费，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份数计算如下：

| | 申购1 | 申购2 | 申购3 |
|---|---|---|---|
| 申购金额（元，A） | 5,000.00 | 1,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 前端申购费率（R） | 1.50% | 1.20% | 1.00% |
| 前端申购费用（元，C=A-A÷（1+R）） | 73.89 | 11,857.71 | 99,009.90 |
| 前端净申购金额（元，D=A-C） | 4,926.11 | 988,142.29 | 9,900,990.10 |
| 前端收费模式申购份数（份，E=D÷1.2000） | 4,105.09 | 823,451.91 | 8,250,825.08 |

如果投资者选择缴纳后端申购费，则在申购时投资者不需缴纳任何费用，各笔申购获得的基金份数计算如下：

| | 申购1 | 申购2 | 申购3 |
|---|---|---|---|
| 申购金额（元，A） | 5,000.00 | 1,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 后端收费模式申购份数（份，F=A÷1.2000） | 4,166.67 | 833,333.33 | 8,333,333.33 |

2、赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。

赎回费以四舍五入的方法保留小数点后两位，余额归基金财产。

①前端收费模式

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例二：假定T日的基金份额净值为1.2000元，投资者赎回10,000份，则：

赎回总额=10,000×1.2000元=12,000元

赎回费用=12,000×0.50%=60元

赎回金额=12,000-60=11,940元

②后端收费模式

赎回总金额=赎回份数×T日基金份额净值

后端申购费=赎回份额×最小值（申购日基金份额净值，赎回日基金份额净值）×对应的后端申购费费率

赎回费=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-后端申购费-赎回费

例三：假如T日的基金份额净值为1.1000元，投资者有一笔金额为1万元的申购，投资者在第三年赎回该笔基金份额，如第三年赎回时基金份额净值为1.4000元，则投资者可获得赎回款12,583.63，投资收益率为26%；投资者在第四年赎回该笔基金份额，如第四年赎回时基金份额净值为1.6000元，则投资者可获得赎回款14,432.73，投资收益率为44%。

计算过程如下：

| | 第三年赎回 | 第四年赎回 |
|---|---|---|
| 申购金额（元，A） | 10,000.00 | 10,000.00 |
| 后端申购份数（B=A/1.1000） | 9,090.91 | 9,090.91 |
| 赎回总金额（C=B×单位净值） | 12,727.27 | 14,545.46 |
| 后端申购费率（D） | 0.80% | 0.40% |
| 后端申购费（E=MIN（A,C×D）） | 80.00 | 40.00 |
| 赎回费（F=C×0.5%） | 63.64 | 72.73 |
| 赎回金额（G=C-E-F） | 12,583.63 | 14,432.73 |
| 投资收益率 | 26% | 44% |

3、转入情况的计算

基金转换以转换申请日的基金份额净值为基础计算，具体计算公式为：

转换金额=转出份数×T日转出基金份额净值

转换费=转换金额×转换费率

补差费=（转换金额-转换费）÷（1+补差费率）×补差费率

转入份数=（转换金额-转换费-补差费）÷T日转入基金份额净值

基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

基金转换费由转换申请人承担，其中25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

例四：某投资者转换1万份基金A至融通新蓝筹混合基金，则转换情况如下：

基金A转换份额10,000份；

基金A转换申请日份额净值（NAV）1.20元；

融通新蓝筹混合基金份额净值（NAV）1.00元

假设基金A的转换费率0.30%（等同于基金A赎回费率）；

假设新蓝筹混合基金应收取的补差费费率为0.20%；

转换金额=10,000×1.20=12,000元；

转换费=12,000×0.30%=36元；

补差费=（12,000-36）÷（1+0.20%）×0.20%=23.88元

转入份数=（12,000-36-23.88）÷1=11,940.12份

注：由于各基金收费模式及费率不同，该例仅作参考。

4、转出情况的计算

基金转换以转换申请日的基金份额净值为基础计算，具体计算公式为：

转换金额=转出份数×T日转出基金份额净值

转换费=转换金额×转换费率

补差费=（转换金额-转换费）÷（1+补差费率）×补差费率

转入基金A份数=（转换金额-转换费-补差费）÷T日转入基金A份额净值

基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

基金转换费由转换申请人承担，其中25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。

例五：某投资者将1万份融通新蓝筹混合基金转换至基金A，则转换情况如下：

转出份额10,000份；

转出申请日份额净值（NAV）1.00元；

基金A份额净值（NAV）1.20元

假设融通新蓝筹混合基金的转换费率0.50%（等同于融通新蓝筹混合基金赎回费率）；

假设基金A应收取的补差费费率为0.10%；

转换金额=10,000×1.00=10,000元；

转换费=10,000×0.50%=50元；

补差费=（10,000-50）÷（1+0.10%）×0.10%=9.94元

转入基金A份数=（10,000-50-9.94）÷1.20=8,283.38份

注：由于各基金收费模式及费率不同，该例仅作参考。

5、基金份额资产净值的计算

T日基金份额资产净值=T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量

本基金份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（九）申购、赎回与转换的注册登记

投资者申购或转换基金成功后，注册登记机构在T+1日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。投资者赎回或转换基金成功后，注册登记机构在T+1日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（十）基金转换的原则

1、基金转换的计算采用"未知价"原则，即基金转换价格以受理申请当日收市后计算的转出及转入基金的基金份额净值为基准进行计算。

2、采用份额转换的方式，即基金转换以份额申请。

3、基金转换无基金份额持有时间限制。

4、基金转换收取适当的基金转换费和补差费。

5、基金转换转出的基金在申请日有权益，确认日开始无权益；基金转换转入的基金在申请日无权益，确认日开始记权益。

6、于2010年3月15日之前已转入的基金份额持有时间按其初始持有时间连续计算。根据中国证监会颁布的《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的要求，于2010年3月15日起转入的基金份额的持有时间自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

7、在发生基金转换时，转出基金必须为允许赎回状态，转入基金必须为允许申购状态。

8、在发生限制申购或巨额赎回的情况下，所涉及到的基金转换按比例确认。如果发生连续巨额赎回，基金转换不顺延。

9、由于前端费用和后端费用的费率结构差异较大，因此，基金转换只允许在缴纳前端认购（申购）费用的基金份额之间或者缴纳后端认购（申购）费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端认购（申购）费用的基金份额转换为缴纳后端认购（申购）费用的基金份额，或将缴纳后端认购（申购）费用的基金份额转换为缴纳前端认购（申购）费用的基金份额。

10、转换费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

11、补差费：对于前端收费模式基金，转出基金的申购费率（或认购费率）高于转入基金的申购费率（或认购费率）时，补差费为0；转出基金的申购费率（或认购费率）低于转入基金的申购费率（或认购费率）时，按申购费率（或认购费率）的差额收取补差费。对于后端收费模式基金，补差费为0。

12、基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申（认）购费率为基础计算，累计不超过最高认购（申购）费率与最低认购（申购）费率的差额。

13、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（十一）赎回份额的认定及处理方式

1、赎回份额的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

①全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

②部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请可能导致基金份额持有人的利益受损或无法实现时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入第二个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

③巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内在公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上进行公告。

（十二）拒绝或暂停申购、暂停赎回、拒绝或暂停转换的情形及处理

1、暂停或拒绝申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停或拒绝接受投资者的申购申请：

①基金管理人认为基金资产规模的扩大有可能对基金份额持有人的利益产生负面影响；

②基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；

③由于不可抗力而导致基金无法正常运作；

④证券交易所交易时间非正常停市；

⑤法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的其他暂停申购情形；

⑥基金管理人认为某笔申购申请可能影响到其他基金份额持有人利益时，可拒绝该笔申购申请。

发生上述第①到第⑤项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停公告。暂停期间，每月至少重复刊登暂停公告一次；暂停结束，基金重新开放申购时，基金管理人应在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登基金重新开放申购公告及最近一个工作日基金份额净值。

对于销售机构已受理的申购申请或发生上述第⑥项拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。

2、暂停赎回的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请：

①不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

②证券交易所交易时间非正常停市；

③因市场剧烈波动或其他原因出现连续巨额赎回，导致基金的现金支付出现困难，基金管理人可以暂停接受赎回申请；

④法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一时，基金管理人在当日向中国证监会报告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分根据基金管理人制定的原则在后续工作日予以兑付，并以该工作日当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。

3、拒绝或暂停转换的情形及处理方式

当转出基金暂停赎回，或转入基金暂停申购时，基金管理人暂停接受基金投资者的转换申请；当转入基金拒绝申购时，基金管理人拒绝接受基金投资者的转换申请。

4、处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回和转换申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当立即在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停公告。暂停期间，基金管理人将每2周至少重复刊登暂停公告一次；暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人公告最近一个工作日基金份额净值。

（十三）重新开放申购、赎回与转换的公告

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购、赎回或转换公告并公布最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前1个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购、赎回或转换日公告最近一个工作日的基金份额净值。

（十四）非交易过户

非交易过户是指由于司法强制执行、继承、捐赠等原因，本公司将某一基金账户的基金份额全部或部分直接划转至另一账户。司法强制执行是指司法机构依据生效法律文书将基金持有人持有的基金单位强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织；继承是指基金持有人死亡，其持有的基金单位由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金单位捐赠给福利性质的基金会或社会团体。办理非交易过户必须提供相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起30个工作日内办理并按基金登记过户机构规定的标准收费。

（十五）转托管

投资者可以以同一基金账户在多个销售机构申购（认购）基金份额，但必须在原申购（认购）的销售机构赎回该基金份额。投资者申购（认购）基金份额后可以向原申购（认购）基金的销售机构发出转托管指令，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。对于有效的基金转托管申请，基金单位将在办理转托管转入手续后转入其指定的销售机构（网点）。

**十五、费用概览**

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用种类

①基金管理人的管理费；

②基金托管人的托管费；

③证券交易费用；

④基金信息披露费用；

⑤基金份额持有人大会费用；

⑥基金成立后与基金相关的会计师费和律师费；

⑦按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的管理费以基金资产净值的1.50%年费率计提。基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

②基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的2.50%的年费率计提。基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

③上述1中③到⑦项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

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资产的损失，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。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。最迟须于新的费率或收费方式实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

①本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

②本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，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。费率如下：

| 申购金额（含申购费） | 费率 |
|---|---|
| 100万元以下 | 1.50% |
| 100万元（含）—1,000万元 | 1.20% |
| 1,000万元（含）—1亿元（含） | 1.00% |
| 超过1亿元以上部分 | 0.00% |

③本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

| 持有时间（T） | 后端申购费率 |
|---|---|
| T<1年 | 1.60% |
| 1年≤T<2年 | 1.20% |
| 2年≤T<3年 | 0.80% |
| 3年≤T<4年 | 0.40% |
| T≥4年 | 0.00% |

1、赎回费按照赎回总金额的0.5%收取，最低赎回费为5元。赎回费用由赎回人承担，赎回费的40%归基金财产。

2、转换费用

①基金转换只允许在缴纳前端申购（认购）费用的基金份额之间或者缴纳后端申购（认购）费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端申购（认购）费用的基金份额转换为缴纳后端申购（认购）费用的基金份额，或将缴纳后端申购（认购）费用的基金份额转换为缴纳前端申购（认购）费用的基金份额。基金转换费用包括转换费和补差费。

②转换费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

③补差费：对于前端收费模式基金，转出基金的申购费率（或认购费率）高于转入基金的申购费率（或认购费率）时，补差费为0；转出基金的申购费率（或认购费率）低于转入基金的申购费率（或认购费率）时，按申购费率（或认购费率）的差额收取补差费。对于后端收费模式基金，补差费为0。

④基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申（认）购费率为基础计算，累计不超过最高认购（申购）费率与最低认购（申购）费率的差额。

⑤基金转换费由转换申请人承担，其中25%归转出基金基金财产，其余作为注册登记费和相关的手续费。基金补差费由转换申请人承担，作为相关的手续费。

（三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

**十六、对招募说明书更新部分的说明**

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2010年4月27日刊登的本基金更新招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、在"第三节 基金管理人"部分，对"（一）基金管理人概况"和"（二）主要人员情况"进行了更新；

2、在"第四节 基金托管人"中，对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况按照最新资料进行了更新；

3、在"第五节 相关服务机构"部分，更新了"直销机构"的地址和"代销机构"的相关信息；

4、在"第九节 基金的投资"部分，更新了"九、基金投资组合报告"的内容，更新数据为本基金2010年2季度报告中的投资组合数据；

5、在"第十节 基金的业绩"部分，按规定要求对基金的投资业绩数据进行了列示，已经基金托管人复核；

6、对"第二十一节 对基金份额持有人的服务"的内容进行了更新；

7、在"第二十二节 其他应披露的事项"部分，对本报告期内的基金公告进行了列表说明。

**融通基金管理有限公司**

**2010年10月27日**

---

(上接B9版)

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的申购申请：

(1)不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

(2)证券交易所因依法决定临时停市或在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

(3)上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、数据错误等；

(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形；

(5)基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；

(6)法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；

(7)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日报中国证监会备案。发生上述(1)到(6)项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

(九)暂停赎回的情形及处理方式

在如下情形，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1)不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

(2)证券交易所因依法决定临时停市或在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

(3)上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、数据错误等；

(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形；

(5)基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；

(6)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体公告。

(十)其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

(十一)集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前予以公告。

基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

(十二)基金的非交易过户等其他业务

基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或注册登记人的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

**十四、备查文件目录**

(一)中国证监会核准中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

(二)《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四)《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件和营业执照

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照

风险提示：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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

**南方基金管理有限公司**

**二〇一〇年十月二十七日**

**附件：基金合同摘要**

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1)分享基金资产收益；

(2)参与分配清算后的剩余基金财产；

(3)依法转让或申请赎回其持有的基金份额；

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7)监督基金管理人的投资运作；

(8)对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1)遵守《基金合同》；

(2)缴纳基金认购、申购、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(3)在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(4)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(5)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及销售机构处获得的不当得利；

(6)执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1)依法募集基金；

(2)自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4)销售基金份额；

(5)召集基金份额持有人大会；

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7)在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8)选择、委托、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用，并从登记结算机构获取基金份额持有人名册；

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

(11)在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12)在符合有关法律法规、交易所及登记结算结构相关业务规则和《基金合同》的前提下，制订和调整本基金业务规则，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(13)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(14)在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(15)以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1)依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金销售机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(2)办理基金备案手续；

(3)自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作