（上接B45版）

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、积极投资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	-	-
C	制造业	18,965,967.44	0.60
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	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	18,965,967.44	0.60

2、指数投资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	19,241,402.08	0.61
B	采矿业	174,819,075.05	5.55
C	制造业	1,041,951,799.88	33.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,445,251.90	3.06
E	建筑业	97,566,513.47	3.10
F	批发和零售业	88,001,169.93	2.79
G	交通运输、仓储和邮政业	78,915,036.18	2.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,950,758.65	2.79
J	金融业	958,379,257.00	30.41
K	房地产业	147,502,194.23	4.68
L	租赁和商务服务业	19,876,120.83	0.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,581,765.05	0.88
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	18,331,499.97	0.58
S	综合	27,571,484.34	0.87
	合计	2,884,133,328.56	91.51

（三）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指数投资明细和前五名积极投资明细

1、指数投资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	2,691,996	101,111,369.76	3.21
2	600036	招商银行	10,036,837	98,561,739.34	3.13
3	600016	民生银行	12,538,203	96,042,634.98	3.05
4	600000	浦发银行	6,790,451	66,003,183.72	2.09
5	601166	兴业银行	6,907,905	65,763,255.60	2.09
6	000002	万 科A	5,946,883	48,110,283.47	1.53
7	600837	海通证券	4,980,629	46,021,011.96	1.46
8	600030	中信证券	4,239,203	44,638,807.59	1.42
9	000651	格力电器	1,468,826	41,127,128.00	1.30
10	600519	贵州茅台	255,219	39,482,379.30	1.25

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000333	美的集团	420,718	18,965,967.44	0.60

（四）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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	53,026,092.00	1.68
8	其他	-	-
9	合计	53,026,092.00	1.68

（五）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	110023	民生转债	415,280	36,756,432.80	1.17
2	113005	平安转债	149,380	14,766,213.00	0.47
3	113002	工行转债	13,110	1,302,871.80	0.04
4	113006	深燃转债	2,080	200,574.40	0.01

（六）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。

（七）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

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）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。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“中国平安”公告其子公司情况外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据2013年5月21日中国平安发布的相关公告，该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚和市场禁入事先告知书》。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元，并处以人民币5,110万元的罚款，暂停其保荐机构资格3个月。

本基金管理人此前投资中国平安股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就中国平安子公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为平安证券存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	391,360.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	95,195.13
5	应收申购款	465,299.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	951,854.92

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	110023	民生转债	36,756,432.80	1.17
2	113002	工行转债	1,302,871.80	0.04

5、报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

6、报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

第十三节 基金的业绩

基金业绩截止日为2013年12月31日。

基金管理人依照恪守职守、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。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。

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
2007年11月11日至2007年12月31日	0.41%	0.09%	5.38%	1.75%	-4.97%	-1.66%
2008年度	-62.61%	2.78%	-61.64%	2.73%	-0.97%	0.05%
2009年度	89.60%	1.93%	84.85%	1.85%	4.75%	0.08%
2010年度	-11.67%	1.50%	-11.03%	1.43%	-0.64%	0.07%
2011年度	-23.57%	1.22%	-22.62%	1.17%	-0.95%	0.05%
2012年度	7.92%	1.19%	7.04%	1.15%	0.88%	0.04%
2013年度	-5.81%	1.31%	-6.65%	1.25%	0.84%	0.06%
2007年11月11日至2013年12月31日	-51.16%	1.74%	-48.59%	1.71%	-2.57%	0.03%

第十四节 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

（一）基金管理人的管理费；

（二）基金托管人的托管费；

（三）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

（四）基金合同生效以后的信息披露费用；

（五）基金份额持有人大会费用；

（六）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（七）基金的资金汇划费用；

（八）基金的指数使用费；

（九）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（二）基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（三）本条第一款第（三）至第（九）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

三、不列入基金费用的项目

本条第一款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

四、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协商酌情调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。基金管理人必须最迟于新的费率实施前2日依照有关规定在指定媒体上公告。

五、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十五节 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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方法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2013年12月25日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期；

2、更新了“第三节 基金管理人”中的相关信息；

3、更新了“第四节 基金托管人”中的相关信息；

4、更新了“第五节 相关服务机构”中的相关信息；

5、更新了“第九节 基金份额的申购、赎回与转换”中的相关信息；

6、更新了“第十节 基金的投资”中基金投资组合报告，为本基金2014年1季度报告的内容；

7、更新了“第十一节 基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核；

8、更新了“第二十二节 对基金份额持有人的服务”中的相关内容；

9、更新了“第二十三节 其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告；

10、更新了“第二十五节 备查文件”中的备查文件存放地点。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站www.gtfund.com。

国泰基金管理有限公司

二〇一四年六月二十四日

（上接B46版）

六、基金的投资目标

以价值投资为本，通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票，长期持有结合适度波段操作，以求在充分控制风险的前提下分享中国经济成长成果和实现基金财产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金以股票、中央银行票据、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为主要投资方向。

八、基金的投资策略

1、债券投资方法

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取积极主动的投资策略，谋取超额收益。如投资有需要则可在严格控制风险的前提下通过回购参与有价的新股配售和增发。

2、股票投资方法

本基金股票投资中，精选个股，长期持有结合适度波段操作，注重长期收益，将类指数的选股方式与积极的权重配置相结合，从而在保持了收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。股票价值分析兼顾收益性和成长性。

具体流程是：首先选择金市场基本面流动性较好、流通市值较大的100只股票；由行业研究小组运用鹏华财务评级系统对其财务指标和资产质量的真实性进行评估，进一步筛选到80只；基金经理再根据市场价格波动的情况，动态分析其价值低估程度，选择收益价值或成长价值相对被低估的50只左右的股票长期投资；为避免行业配置过于集中，由金融工程研究员对拟投资组合进行行业比例测算，如果个别行业的投资比例过高，则进行适当之调整。

3、决策程序

投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需及时做出重大决策或经基金管理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。

金融工程研究员及行业研究员：对于宏观经济、行业、上市公司、投资策略、金融工程、可投资股票备选库的建立与完善、投资风险控制与基金绩效评估等与投资决策有关的内容进行全面深入的研究，作为投资决策的依据。

基金管理部：构造和调整投资组合，设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：投资决策委员会决议、每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同所设定的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理向交易员分配交易指令，交易员执行投资指令。

绩效与风险评估小组：对基金投资组合进行绩效评估，对各种投资风险指标进行测量并向基金管理小组提出预警和调整建议。

监察稽核部：对投资流程的合法合规性进行监控。

九、基金的业绩比较基准

上证180指数涨跌幅×65%＋深证100指数涨跌幅×30%＋金融同业存款利率×5%

本基金主要以基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票为投资对象，且股票投资目有限，适合用成分指数作为比较基准。而上证180指数和深证100指数分别是上交所和深交所最重要的成分指数，分别代表了这两个交易所中总市值、成交量最大的一部分A股，成长性强、估值水平低，具有很高的投资价值。

本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金属平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2014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。

本报告中所列财务数据截至2014年3月31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	2,138,475,301.32	73.99
	其中:股票	2,138,475,301.32	73.99
2	固定收益投资	194,766,500.00	6.74
	其中:债券	194,766,500.00	6.74
	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	498,378,098.19	17.24
7	其他资产	58,464,437.68	2.02
8	合计	2,890,084,337.19	100.00

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	-	-
C	制造业	1,731,838,154.81	60.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,780,897.12	1.35
E	建筑业	101,411,105.95	3.52
F	批发和零售业	11,413,029.04	0.40
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	143,467,754.40	4.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	111,564,360.00	3.87
L	租赁和商务服务业	-	-
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	2,138,475,301.32	74.25

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	600887	伊利股份	5,238,216	187,685,279.28	6.52
2	000333	美的集团	3,783,386	170,555,040.88	5.92
3	002250	联化科技	7,299,969	134,538,428.67	4.67
4	600276	恒瑞医药	3,297,817	110,410,913.16	3.83
5	600557	康缘药业	2,853,583	87,005,745.67	3.02
6	601633	长城汽车	2,599,862	84,417,519.14	2.93
7	600703	三安光电	2,949,831	67,108,655.25	2.33
8	000024	招商地产	3,500,000	66,010,000.00	2.29
9	002152	广电运通	3,666,178	64,964,674.16	2.26
10	000530	大冷股份	6,799,927	63,851,314.53	2.22

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	194,766,500.00	6.76
	其中:政策性金融债	194,766,500.00	6.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	194,766,500.00	6.76

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	130311	13进出11	550,000	54,906,500.00	1.91
2	130243	13国开43	500,000	49,935,000.00	1.73
3	120409	12农发09	500,000	49,925,000.00	1.73
4	130322	13进出22	300,000	30,000,000.00	1.04
5	130218	13国开18	100,000	10,000,000.00	0.35

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11.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	1,192,262.83
2	应收证券清算款	51,712,301.34
3	应收股利	-
4	应收利息	5,025,962.21
5	应收申购款	533,911.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,464,437.68

（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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

（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。

十二、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
2004年5月12日至2004年12月31日	-4.90%	0.68%	-13.42%	1.09%	8.52%	-0.41%
2005年1月1日至2005年12月31日	5.15%	0.89%	-7.45%	1.28%	12.60%	-0.39%
2006年1月1日至2006年12月31日	157.92%	1.30%	115.20%	1.34%	42.72%	-0.04%
2007年1月1日至2007年12月31日	127.81%	1.98%	149.71%	2.18%	-21.90%	-0.20%
2008年1月1日至2008年12月31日	-48.86%	2.08%	-63.21%	2.89%	14.35%	-0.81%
2009年1月1日至2009年12月31日	73.87%	1.57%	92.86%	1.97%	-18.99%	-0.40%
2010年1月1日至2010年12月31日	3.58%	1.26%	-11.40%	1.51%	14.98%	-0.25%
2011年1月1日至2011年12月31日	-23.88%	1.09%	-24.24%	1.25%	0.36%	-0.16%
2012年1月1日至2012年12月31日	13.41%	0.97%	8.14%	1.24%	5.27%	-0.27%
2013年1月1日至2013年12月31日	10.02%	1.03%	-6.84%	1.34%	16.86%	-0.31%
2014年1月1日至2014年3月31日	-9.30%	1.14%	-7.44%	1.14%	-1.86%	0.00%
自基金合同生效起至2014年3月31日	366.65%	1.38%	91.24%	1.72%	275.41%	-0.34%

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）：上证180指数涨跌幅×65%＋深证100指数涨跌幅×30%＋金融同业存款利率×5%。

注2：本基金基金合同于2004年5月12日生效；

注3：基金业绩截止日为2014年3月31日。

十三、基金的费用

（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）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）与基金相关的会计师费、审计费、验资费和律师费；

（7）其他按照国家有关规定可以列入的费用。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规和相应协议的规定，按费用的实际支出金额支付，列入当期基金费用。国家另有规定的从其规定。

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

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。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2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）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的2.5%年费率计提。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，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金资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）本条第1款第（3）至第（7）项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

3、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提商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

基金的申购费由申购人承担，不计入基金财产，投资者通过场外、场内申购本基金的申购费率相同。

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特定申购费率如下表：

申购金额M	特定申购费率
1000元≤M＜10万元	0.60%
10万元≤M＜100万元	0.60%
100万元≤M＜500万元	0.30%
M≥500万元	0.02%

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率如下表：

申购金额M	申购费率
1000元≤M＜10万元	1.50%
10万元≤M＜100万元	1.00%
100万元≤M＜500万元	0.50%
M≥500万元	0.02%

注：投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

场外计算公式：

申购费用＝申购金额／（1＋申购费率）×申购费率

净申购金额＝申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/T日基金份额净值

场内计算公式：

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率）

申购手续费＝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

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

2、赎回费用

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，扣除由基金管理人等相关当事人收取的注册登记等费用后归基金资产。本基金的场内赎回费率按持有年限逐年递减，具体赎回费率如下：

持有年限（Y）	赎回费率
Y＜1年	0.5%
1年≤Y＜2年	0.3%
2年≤Y＜3年	0.1%
3年≤Y	0

说明：赎回费由赎回申请人承担，其中60%作为注册登记费用由基金管理人收取，40%归基金财产。

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%。赎回费由赎回申请人承担，其中60%作为注册登记等费用，40%归入基金财产。

场外计算公式：

赎回费 ＝ 赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回金额 ＝ 赎回当日基金份额净值×赎回份额－赎回费

场内计算公式：

赎回总金额＝赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回手续费＝赎回总金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回总金额－赎回手续费

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

3、转换费用

本基金已经开通与本基金管理人旗下其它基金的转换业务，相关基金转换费率、计算公式、使用方法及转换业务规则等相关规定请查看相关业务公告。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率，无须召开基金份额持有人大会。本基金可在中国证监会允许的条件下按国家的有关规定增加其他种类的基金费用。如本基金仅对新发售的基金份额适用新的基金费用种类，不涉及现有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前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。调整后的上述费率还将在最新的招募说明书中列示。

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形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。对部分投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

（三）其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

（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事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产列支，国家另有规定的除外。

十四、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，对本基金管理人原公告的本基金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。

2、对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。

3、对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。

4、对“五、相关服务机构”内容进行了更新。

5、对“九、基金的投资”部分内容进行了更新。

6、对“十、基金的业绩”部分内容进行了更新。

7、对“二十一、对基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。

8、对“二十二、其他应披露事项”内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2014年6月24日

证券代码：002204 证券简称：大连重工 公告编号：2014-030

大连华锐重工集团股份有限公司第三届董事会第十三次会议决议公告

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。

大连华锐重工集团股份有限公司第三届董事会第十三次会议于2014年6月20日以传真和电子邮件的方式发出会议通知，于6月23日在大连华锐大厦十三楼国际会议厅召开。会议应出席董事9名，实际出席董事7名，董事王茂凯先生因公务未出席本次会议，委托董事陆朝昌先生出席并代为行使表决权；独立董事陈树文因公务未出席本次会议，委托独立董事史永东先生出席并代为行使表决权。公司监事和高级管理人员列席会议。会议的召开符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》的有关规定。会议由公司董事长宋甲晶先生主持。

会议以举手表决的方式逐项审议通过了下列议案：

一、《关于回购大连重工·起重集团有限公司标的资产未完成盈利承诺所对应股份的议案》

具体内容详见刊载于《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn上的公告。

表决结果：同意5票，反对0票，弃权0票。

（关联董事宋甲晶先生、贾祥晶先生、王茂凯先生、陆朝昌先生回避表决）。

本议案需提请股东大会审议。

二、《关于提请股东大会授权公司董事会全权办理回购相关事宜或者股份赠与相关事宜的议案》

具体内容详见刊载于《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn上的公告。

表决结果：同意9票，反对0票，弃权0票。

本议案需提请股东大会审议。

三、《关于召开2014年第二次临时股东大会的议案》

根据《公司章程》规定，定于2014年7月10日以现场会议与网络投票相结合的方式，在大连华锐大厦十三楼国际会议厅召开2014年第二次临时股东大会。

表决结果：同意9票，反对0票，弃权0票。

特此公告

大连华锐重工集团股份有限公司

董 事 会

2014年6月24日

证券代码：002204 证券简称：大连重工 公告编号：2014-031

大连华锐重工集团股份有限公司关于回购大连重工·起重集团有限公司标的资产未完成盈利承诺所对应股份的公告

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。

根据2011年重组期间公司与大连重工·起重集团有限公司（下称大连重工·起重）签订的《利润补偿框架协议》和《利润补偿框架协议的补充协议》（下称《补偿协议》），鉴于重组标的资产2012年、2013年盈利未达承诺，公司拟回购大连重工·起重标的资产未完成盈利承诺所对应股份，具体情况如下：

一、未完成盈利承诺所对应股份数量

根据《补偿协议》，大连重工·起