（上接B50版）

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

代码	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	601299	中国北车	1,599,912	8,431,536.24	1.79
2	601006	大秦铁路	1,038,278	8,077,802.84	1.71
3	601668	中国建筑	2,300,000	7,797,000.00	1.65
4	000099	中信海直	464,426	5,596,333.30	1.19
5	600585	海螺水泥	269,913	4,637,105.34	0.98
6	600795	国电电力	1,700,000	4,386,000.00	0.93
7	601929	吉视传媒	319,944	4,188,066.96	0.89
8	601989	中国重工	632,910	4,151,889.60	0.88
9	600999	招商证券	350,000	4,070,500.00	0.86
10	000024	招商地产	300,000	3,687,000.00	0.78

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	20,010,000.00	4.24
	其中：政策性金融债	20,010,000.00	4.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	598,190,565.65	126.85
8	其他	-	-
9	合计	618,200,565.65	131.10

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	110015	石化转债	1,004,390	109,508,641.70	23.22
2	110018	国电转债	885,210	104,206,921.20	22.10
3	113001	中行转债	715,120	74,057,827.20	15.70
4	110020	南山转债	524,630	59,026,121.30	12.52
5	113002	工行转债	498,860	54,310,888.20	11.52

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
无。

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
无。

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
无。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策
本基金报告期内未投资于国债期货。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

9.3 本期国债期货投资评价
本基金报告期内未投资于国债期货。

10、投资组合报告附注

10.1 本基金本报告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中，由中国石油化工股份有限公司发行的石化转债（110015）于2013年11月25日公告，由于原油管道破裂致使排水暗渠爆炸，从而引发人员伤亡事故，中国政府已派出事故调查组进行全面调查。2014年1月，国务院事故调查组对中国石油化工股份有限公司及相关责任人分别给予纪律处分，中国石油化工股份有限公司于1月13日披露相关处罚结果。目前该公司生产经营稳定，成品油市场供应稳定，该处罚不影响持有该债券。

10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	74,247.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,419,735.99
5	应收申购款	10,363,940.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,857,924.07

10.4 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）	占基金资产的净值比例（%）
1	110015	石化转债	109,508,641.70	23.22
2	110018	国电转债	104,206,921.20	22.10
3	113001	中行转债	74,057,827.20	15.70
4	110020	南山转债	59,026,121.30	12.52
5	113002	工行转债	54,310,888.20	11.52
6	113003	重工转债	47,859,790.00	10.15
7	110024	隧道转债	38,241,523.20	8.11
8	113005	平安转债	24,297,900.00	5.15
9	110019	恒丰转债	11,612,515.20	2.46
10	128004	久立转债	8,261,902.35	1.75
11	127002	徐工转债	1,709,430.00	0.36
12	128003	华天转债	477,690.50	0.10
13	113006	深燃转债	337,761.10	0.07

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

十二、基金的业绩

基金业绩截至日为2014年9月30日。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（1）建信转债增强债券A：

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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5月29日-2012年12月31日	5.80%	0.22%	-0.36%	0.27%	6.16%	-0.05%
2013年1月1日-2013年12月31日	-3.97%	0.87%	-1.55%	0.50%	-2.42%	0.37%
2014年1月1日-2014年9月30日	24.31%	0.93%	8.85%	0.37%	15.46%	0.56%
2012年5月29日-2014年9月30日	26.30%	0.78%	6.77%	0.41%	19.53%	0.37%

（2）建信转债增强债券C：

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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5月29日-2012年12月31日	5.60%	0.22%	-0.36%	0.27%	5.96%	-0.05%
2013年1月1日-2013年12月31日	-4.36%	0.88%	-1.55%	0.50%	-2.81%	0.38%
2014年1月1日-2014年9月30日	23.96%	0.93%	8.85%	0.37%	15.11%	0.56%
2012年5月29日-2014年9月30日	25.20%	0.78%	6.77%	0.41%	18.43%	0.37%

十三、基金的费用概览

（一）认购费用

本基金基金份额分为A类和C类基金份额。A类基金份额在认购时收取认购费，C类基金份额在认购时不收取认购费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金认购费率如下表所示。

费用种类	A类基金份额		C类基金份额
认购费	M<100万元	0.6%	0%
	100万元≤M<500万元	0.4%	
	M≥500万元	1000元/笔	

注：M为累计认购金额。

本基金认购费由认购人承担，不列入基金财产。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。投资者可以多次认购本基金，认购费用按累计认购金额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。

（二）认购份数的计算

本基金的认购价格为每份基金份额1.00元。

有效认购款项在基金募集期间形成的利息归投资者所有，如基金合同生效，则折算为基金份额计入投资者的账户，利息和具体份额以注册登记机构的记录为准。

基金份额的认购份额计算方法：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额发售面值

例一：某投资者投资5万元认购本基金A类份额，如果认购期内认购资金获得的利息为5元，则可得到的认购份额为：

净认购金额=50,000/（1+0.6%）=49,701.79元

认购费用=50,000-49,701.79=298.21元

认购份额=（49,701.79+5）/1.00=49,706.79份

即：投资者投资5万元认购本基金A类份额，则其可得到49,706.79份本基金A类份额。

例二：某投资者投资5万元认购本基金C类份额，如果认购期内认购资金获得的利息为5元，则可得到的认购份额为：

净认购金额=50,000/（1+0%）=50,000元

认购费用=50,000-50,000=0元

认购份额=（50,000+5）/1.00=50,005.00份

即：投资者投资5万元认购本基金C类份额，则其可得到50,005.00份本基金C类份额。

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（三）申购费与赎回费

1、申购费

投资者在申购本基金A类基金份额时，收取申购费用，申购费率随申购金额增加而递减；投资者可以多次申购本基金，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。本基金C类基金份额不收取申购费。

本基金的申购费率如下表所示：

费用种类	A类基金份额		C类基金份额
申购费	M<100万元	0.8%	0%
	100万元≤M<500万元	0.5%	
	M≥500万元	1000元/笔	

注：M为每日累计申购金额

本基金的申购费用应在投资者申购A类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，具体赎回费率如下表所示：

费用种类	情形	费率
A类赎回费率	N<1年	0.1%
	1年≤N<2年	0.05%
	N≥2年	0
C类赎回费率	N<30天	0.3%
	N≥30天	0

注：N为基金份额持有期限；1年指365天。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整申购费率或收费方式，或者调低赎回费率，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告。

（四）申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

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

申购份数=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例一：某投资者投资5万元申购本基金的A类基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50000/（1+0.8%）=49603.17元

申购费用=50000-49603.17=396.83元

申购份额=49603.17/1.05=47241.11份

即：投资者投资5万元申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.05元，则其可得到47241.11份A类基金份额。

例二：某投资者投资5万元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50000/（1+0%）=50000元

申购费用=50000-50000=0元

申购份额=50000/1.05=47619.05份

即：投资者投资5万元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.05元，则其可得到47619.05份C类基金份额。

2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例一：某投资者赎回本基金10000份A类基金份额，赎回适用费率为0.1%，假设赎回当日A类基金份额净值为1.148元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.148=11480元

赎回费用=11480×0.1%=11.48元

净赎回金额=11480-11.48=11468.52元

即：投资者赎回本基金10000份A类基金份额，假设赎回当日A类基金份额净值为1.148元，则可得到的净赎回金额为11468.52元。

例二：某投资者赎回本基金10000份C类基金份额，假设持有期大于30天，则赎回适用费率为0%，假设赎回当日C类基金份额净值为1.148元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.148=11480元

赎回费用=11480×0%=0元

净赎回金额=11480-0=11480.00元

即：投资者赎回本基金10000份C类基金份额，假设赎回当日C类基金份额净值为1.148元，持有期大于30天，则可得到的净赎回金额为11480.00元。

3、基金份额净值计算

基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（五）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、基金销售服务费；本基金从C类基金资产中计提的销售服务费；

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；

5、基金合同生效以后的信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

8、基金资产的资金汇划费用；

9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（六）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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.75%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0.75%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.75%÷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，由基金托管人于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、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0.2%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0.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%÷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，经基金托管人复核后，由基金托管人于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。

销售服务费计算方法如下，按C类基金份额基金资产净值计提：

H=E×0.35%÷当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后，由基金托管人于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

4、本条第（一）款第4至第9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。

（七）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，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。

（八）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和销售服务费，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日2日前在指定媒体上刊登公告。

（九）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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了“四、基金托管人”的“托管业务经营情况”。

2、在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构信息。

3、更新了“九、基金的投资”，更新了基金投资组合报告，并经基金托管人复核。

4、更新了“十、基金的业绩”，并经基金托管人复核。

5、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中有关服务提供信息。

6、更新了“二十二、其他应披露事项”，添加了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

上述内容仅为本招募说明书（更新）摘要，投资人欲查询本更新招募说明书正文，可登陆基金管理人网站www.ccbfund.cn。

建信基金管理有限责任公司
二〇一五年一月十日

（上接B52版）

为了避免自下而上的选股方法造成的行业集中度过高而引起的组合流动性下降的风险，以及较高的组合非系统性风险，本基金将在对行业的基本面趋势、行业整体估值水平等因素进行深入研究的基础上，对股票组合进行适当的行业分布调整。

2、大类资产配置策略

大类资产配置策略是指“基于宏观经济和证券市场运行环境的整体研究，结合内部和外部的研究支持，本基金管理人分析判断股票和债券估值的相对吸引力，从而决定各大类资产配置比例的调整方案，进行主动的仓位控制”。

本基金为混合型基金，以股票投资为主，一般情况下本基金将保持配置的基本稳定，最高可到95%。大类资产配置策略不作为本基金的核心策略，但考虑到中国A股市场现阶段仍存在较大的系统性风险，本基金在某些特定的市场状况下会进行大类资产配置调整（股票投资的比例最低不低于30%）。

本基金需要进行大类资产配置调整的特定市场状况主要指股票市场的整体估值水平严重地偏离了企业实际的盈利状况和预期的成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失的情况。

3、债券投资策略

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，自上而下，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券和货币市场工具组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta对冲策略等。

（二）投资决策依据

1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；

2、投资分析团队对于宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议；

3、投资分析团队对于企业和债券基础分析的报告和建议；

4、投资风险管理人员对于投资组合风险评估的报告和建议。

（三）投资决策机制

1、投资决策委员会负责审定基金经理的整体投资策略和原则；审定基金经理季度资产配置和调整计划；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

2、基金经理：在投资决策委员会的授权范围内，根据基金的投资政策实施投资管理，确定具体的投资品种、数量、策略，构建优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理。

3、基金经理助理／投资分析员：通过内部调研和参考外部研究报告，编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告，提交基金经理，作为投资决策的依据。

（四）投资程序

1、研究部、数量化投资部和交易部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关上市公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

2、投资决策委员会依据上述报告对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划。

4、交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中信标普国债指数×40%

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定被市场广泛认同的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的中信标普国债指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属主动管理的混合型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

十一、基金的投资组合报告

投资组合报告截止日为2014年9月30日。

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	2,299,044,712.51	91.84
	其中：股票	2,299,044,712.51	91.84
2	固定收益投资	110,163,000.00	4.40
	其中：债券	110,163,000.00	4.40
	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	61,948,716.98	2.47
7	其他资产	32,162,550.17	1.28
8	合计	2,503,318,979.66	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	采掘业	31,085,684.49	1.26
C	制造业	1,094,202,199.80	44.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,413,806.25	2.50
E	建筑业	143,170,779.81	5.82
F	批发和零售业	289,616,004.26	11.77
G	交通运输、仓储和邮政业	22,649,101.44	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,919,306.70	0.16
J	金融业	278,715,380.53	11.33
K	房地产业	297,241,072.20	12.08
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	27,249,743.85	1.11
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	12,702,008.96	0.52
S	综合	37,079,624.22	1.51
	合计	2,299,044,712.51	93.42

3、 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	002037	久联发展	9,508,179	152,891,518.32	6.21
2	600048	保利地产	23,921,450	132,764,047.50	5.39
3	002310	东方园林	5,322,079	100,214,747.57	4.07
4	600153	建发股份	12,588,284	80,816,783.28	3.28
5	600705	中航资本	3,861,806	72,717,806.98	2.95
6	000417	合肥百货	9,944,707	65,833,960.34	2.68
7	000801	四川九洲	2,798,014	59,737,598.90	2.43
8	002450	康得新	1,882,036	58,568,960.32	2.38
9	600089	特变电工	5,699,859	56,827,594.23	2.31
10	600151	航天机电	5,299,974	55,702,726.74	2.26

4、 报告期末按券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	110,163,000.00	4.48
	其中：政策性金融债	110,163,000.00	4.48
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	110,163,000.00	4.48

5、 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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	140207	14国开07	600,000	60,138,000.00	2.44
2	130243	13国开43	500,000	50,025,000.00	2.03

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。

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。

8、投资组合报告附注

1）报告期内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的，也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2）基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3）基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	740,958.43
2	应收证券清算款	27,851,666.29
3	应收股利	-
4	应收利息	3,518,647.33
5	应收申购款	51,278.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,162,550.17

4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至本报告期末，本基金未持有处于转股期可转换债券。

5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600705	中航资本	72,717,806.98	2.95	临时停牌

十二、基金的业绩

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。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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2014年9月30日。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

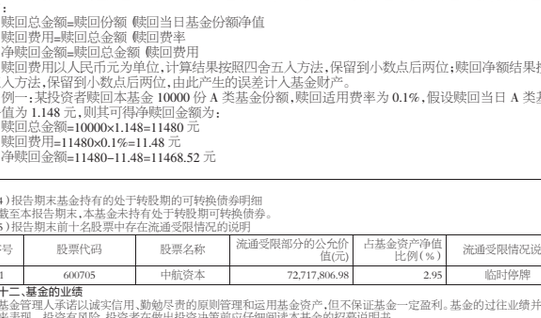
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效至2007年12月31日	29.46%	1.45%	18.86%	1.39%	10.60%	0.06%
2008年	-43.14%	1.81%	-44.16%	1.83%	1.02%	-0.02%
2009年	43.16%	1.73%	52.60%	1.23%	-9.44%	0.50%
2010年	7.03%	1.40%	-5.99%	0.95%	13.02%	0.45%
2011年	-31.01%	1.26%	-13.97%	0.78%	-17.04%	0.48%
2012年	12.01%	1.18%	6.32%	0.76%	5.69%	0.42%
2013年	8.51%	1.18%	-3.75%	0.84%	12.26%	0.34%
过去3个月	17.41%	0.96%	8.26%	0.53%	9.15%	0.43%

2、基金收益分配情况

期间	每10份基金份额分红数（元）	备注
基金合同生效日至2007年年底	-	-
2008年	-	-
2009年	-	-
2010年	0.30	2010年1月18日实施
2011年	0.20	2011年1月14日实施
2012年	-	-
2013年	-	-
合计	0.50	

3、图示自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的比较

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：图示日期为2007年5月29日至2014年9月30日。

十三、基金的费用概览

（一）基金运作有关的费用

1、基金运作费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）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）；

（4）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）基金的资金汇划费用；

（8）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金运作费用的计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%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，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，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，如降低基金管理费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施3个工作日前在中国证监会指定媒体公告。

（2）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0.25%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0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷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，经基金托管人复核后，由基金托管人于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。

销售服务费计算方法如下，按C类基金份额基金资产净值计提：

H＝E×0.35%÷当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后，由基金托管人于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

4、本条第（一）款第4至第9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。

（七）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，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。

（八）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和销售服务费，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日2日前在指定媒体上刊登公告。

（九）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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了“四、基金托管人”的“托管业务经营情况”。

2、在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构信息。

3、更新了“九、基金的投资”，更新了基金投资组合报告，并经基金托管人复核。

4、更新了“十、基金的业绩”，并经基金托管人复核。

5、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中有关服务提供信息。

6、更新了“二十二、其他应披露事项”，添加了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

上述内容仅为本招募说明书（更新）摘要，投资人欲查询本更新招募说明书正文，可登陆基金管理人网站www.ccbfund.cn。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一五年一月十日

（上接B49版）

八、基金的投资方向

本基金投资于国内依法公开发行的股票、权证、债券、资产支持证券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

九、基金的投资策略

本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置；在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

1. 总体资产配置策略

本基金以股票投资为主、债券投资为辅进行积极资产配置。其中，股票资产占基金资产的比例范围为60%－95%；债券资产占基金资产的比例范围为0%－35%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金采取趋势投资策略进行总体资产配置，即通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素“自上而下”的定量和定性分析，形成对各个市场的趋势判断，在此基础上基于稳健的战略资产配置策略和积极的战术资产配置策略，确定组合中股票、债券和货币市场工具的投资比例。

2. 行业配置策略

本基金采用行业轮动投资策略进行行业配置，即紧密跟踪国家产业政策和行业经济运行状况及其政策动态，关注产业结构调整，通过行业周期分析、行业特征指标分析、行业内竞争结构分析以及国际产业迁移进程分析等确定本基金各行业的投资比例，当预计某个行业的投资收益率发生变化时，动态调整各行业的投资比例。同时，利用数量化模型优化行业组合，增强本基金行业配置效率。

本基金将重点投资于符合国家宏观经济和产业发展政策，与国民经济增长高度相关，能够适应、满足、推动消费升级及产业升级等需要，具有垄断特征以及高附加值等行业，适时采用行业集中或者行业分散策略，获取行业超额收益，平抑宏观经济的周期性变化对股价波动带来的影响，保持基金分红水平与净值的长期协调稳定增长。

3. 个股选择策略

本基金采用核心-卫星策略，进行股票资产配置，即本基金股