(上接B68版)

其中,投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产净值的80%;投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构在《基金合同》与托管协议生效以后允许基金投资于其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金管理人应当自《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》的约定。

八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期指数成份股或权重调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因市场因素影响或法律法规限制等特殊情况导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以股指期货等金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。

本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)

本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的被动式、指数型基金,对中证上游资源产业指数成份股的配置基准约为95%,并适度运用股指期货增强指数跟踪效果,故以此为业绩比较基准,能够较为准确地反映本基金的投资绩效。

如果中证上游资源产业指数被停止编制及发布,或者中证上游资源产业指数由其他指数替代(单纯更名除外),或者由于指数编制方法等重大变更导致中证上游资源产业指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则,履行适当程序后变更本基金的标的指数和业绩比较基准。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,于变更前2个工作日在指定媒体上予以公告并在变更后5个工作日内报中国证监会备案。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、 基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	160,314,384.61	92.25
	其中:股票	160,314,384.61	92.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,464,493.78	7.17
8	其他各项资产	1,012,849.14	0.58
9	合计	173,791,727.53	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合(1)报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	99,272,255.41	58.42
C	制造业	56,422,524.09	33.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	899,488.81	0.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,717,749.00	2.19
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	160,312,017.31	94.33

(2)报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,367.30	-
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	2,367.30	-

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)期末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

金额单位:人民币元

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	600028	中国石化	1,828,311	12,907,875.66	7.60
2	601857	中国石油	845,909	9,584,148.97	5.64
3	601899	紫金矿业	1,653,945	8,468,198.40	4.98
4	601600	中国铝业	834,291	7,783,935.03	4.58
5	601088	中国神华	344,760	7,188,246.00	4.23
6	600111	北方稀土	379,649	6,886,832.86	4.05
7	600583	海油工程	385,506	6,422,529.96	3.78
8	600256	广汇能源	545,293	5,671,047.20	3.34
9	000630	铜陵有色	421,306	4,347,877.92	2.56
10	000060	中金岭南	231,022	4,294,698.98	2.53

(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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002428	云南锗业	52	1,222.52	-
2	600432	吉恩镍业	56	932.96	-
3	600490	鹏欣资源	17	211.82	-

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券资产。

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

本基金本报告期末未持有债券资产。

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投资。

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资产。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,以套期保值为目的,适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。

(2)基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3)期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,822.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,018.74
5	应收申购款	953,007.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,012,849.14

(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债券资产。

(5)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000630	铜陵有色	4,347,877.92	2.56	重大事项停牌

(6)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资股票不存在流通受限情况。

(7)本基金本期末投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

十二、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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现详见下表:

国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止2015年6月30日)

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
2011.07.21(基金合同生效日)至2011.12.31	-22.00%	1.03%	-31.30%	1.62%	9.30%	-0.59%
2012.01.01至2012.12.31	4.87%	1.63%	4.41%	1.63%	0.46%	0.00%
2013.01.01至2013.12.31	-34.11%	1.44%	-34.78%	1.44%	0.67%	0.00%
2014.01.01至2014.12.31	26.16%	1.31%	25.70%	1.31%	0.46%	0.00%
2015.01.01至2015.3.31	12.79%	2.04%	12.82%	2.03%	-0.03%	0.01%
2015.04.01至2015.6.30	11.08%	2.82%	11.31%	2.71%	-0.23%	0.11%
自基金合同生效日起至今	-14.80%	1.59%	-26.15%	1.63%	11.35%	-0.04%

注:1、本基金是以中证上游资源产业指数为标的指数的被动式、指数型基金,故以95%×中证上游资源产业指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)作为本基金业绩比较基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

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》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金上市费及年费;

9、基金的指数使用费;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.6%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.13%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.13%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提,且收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币5 万元。计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算,逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于次季初10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

4、上述一、基金费用的种类中第3-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《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、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)与基金销售有关的费用

1、申购费率

(1)本基金的场外前端申购费率如下表:

申购金额(M)	前端申购费率
M<100万元	1.2%
100万元≤M<500万元	0.8%
M≥500万元	每笔1,000元

(2)本基金的场外后端申购费率如下表:

持有时间(Y)	后端申购费率
Y<1年	1.4%
1年≤Y<2年	1.0%
2年≤Y<3年	0.5%
Y≥3年	0

(3)本基金的场内申购费率由基金代销机构比照场外前端申购费率执行。

(4)本基金的申购费用由基金申购人承担,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。赎回费用由基金赎回人承担。

2、赎回费率

(1)本基金的的场外赎回费率如下表:

持有时间(T)	赎回费率
T<1年	0.5%
1≤T<2年	0.25%
T≥2年	0%

注:上表中,1年按365天计算。

(2)本基金的场内赎回费率固定为0.5%。

(3)投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%。

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调低申购费率、赎回费率或调整收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。

4、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)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(五)与基金销售有关的费用的计算

1、申购费用的计算

前端申购费用=申购金额×前端申购费率/(1+前端申购费率)

后端申购费用=赎回份额×申购当日基金份额净值×后端申购费率

2、赎回费用的计算

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

(六)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体上公告。

(七)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、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》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)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2015年3月6日刊登的国投瑞银中证上游资源产业指数证券投资基金(LOF)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及投资组合报告的截止日期。

2、在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人的信息。

3、在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的信息。

4、在"五、相关服务机构"部分,更新了原有销售机构的信息,增加了新增代销机构的概况。

5、在"九、基金的投资"部分,更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

6、在"十、基金的业绩"部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

7、在"十二、基金资产估值"部分,调整了交易所固定收益品种的估值方法。

8、在"二十二、其他应披露事项"部分,更新披露了自上次招募说明书截止日以来涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。

上述内容仅为本基金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详细内容,可登录国投瑞银基金管理有限公司网站www.ubssdic.com。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一五年九月一日

(上接B65版)

(8)募集资金数额及用途

本次非公开发行募集资金总额不超过141,000.00万元(含发行费用),扣除发行费用后,计划投资于以下项目:

序号	项目名称	投资总额	募集资金金额
1	康力优蓝服务机器人项目	48,960.00	48,960.00
2	基于物联网技术的智能电梯云服务平台项目	25,400.00	25,400.00
3	康力电梯智能制造工厂项目	40,707.36	38,500.00
4	康力电梯试验中心项目	32,100.00	24,000.00
合计		147,167.36	136,860.00

注:康力优蓝服务机器人项目分两部分完成,一是公司收购康力优蓝56%的股权,金额为8,960万元,其中以股票支付对价4,480万元,以非公开发行募集的现金支付对价4,480万元;二是以本次非公开发行募集资金向康力优蓝进行增资,增资金额为40,000万元。

在本次非公开发行募集资金到位之前,公司将根据项目进度的实际情况以自筹资金先行投入,并在募集资金到位后予以置换。若本次募集资金净额少于上述项目拟投入募集资金总额,公司将根据实际募集资金数额,按照项目的轻重缓急等情况,调整并最终决定募集资金投入的优先顺序及各项目的具体投资额,募集资金不足部分由公司以自有资金解决。

(9)决议有效期

本次发行决议自公司股东大会审议通过之日起十二个月内有效。如果公司已于该有效期内取得中国证监会对本次非公开发行股票的核准文件,则本决议有效期自动延长至本次非公开发行股票完成日。

本议案尚须提交公司2015年度第一次临时股东大会逐项审议通过,并经中国证监会核准后方可实施,最终以中国证监会核准的方案为准。

3、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司本次非公开发行A股股票预案的议案》;

《关于公司本次非公开发行A股股票预案》详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

4、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司本次非公开发行A股股票募集资金使用可行性分析报告的议案》;

《公司非公开发行A股股票募集资金使用可行性分析报告》详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

5、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司前次募集资金使用情况报告的议案》;

监事会认为公司董事会对前次募集资金使用情况做出的该专项报告符合《公司法》、《证券法》以及中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《前次募集资金使用情况报告的规定》等有关法律、法规的规定,如实反映了公司前次募集资金的使用情况。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

6、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,逐项审议通过了《关于公司与特定对象签署附条件生效的股份认购合同的议案》;

根据本次非公开发行方案,公司分别与建信基金管理有限责任公司(代表"建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划")、刘雪楠和沈刚签署了附生效条件的《股份认购合同》。

该合同在本次非公开发行股票获得公司董事会、股东大会审议通过且获得中国证监会核准后生效。

同意公司与特定对象签署附条件生效的股份认购合同:

(1)公司与建信基金管理有限责任公司(代表"建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划")签署的附条件生效的《股份认购合同》;

(2)公司与刘雪楠签署的附条件生效的《股份认购合同》;

(3)公司与沈刚签署的附条件生效的《股份认购合同》。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

7、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司与刘雪楠、沈刚关于北京康力优蓝机器人科技有限公司之股权转让协议的议案》;

公司以部分本次非公开发行的股票和部分本次非公开发行募集的资金收购刘雪楠、沈刚持有的北京康力优蓝机器人科技有限公司合计56%的股权。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

8、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司对子公司北京康力优蓝机器人科技有限公司进行增资的议案》;

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

9、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司与王友林签署附条件生效的股份对价支付合作协议的议案》;

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

10、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司本次非公开发行A股股票涉及关联交易事项的议案》;

《关于公司本次非公开发行A股股票涉及关联交易事项的公告》详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

11、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于批准本次非公开发行股票募集资金拟收购标的资产相关审计报告、评估报告的议案》;

相关审计报告、评估报告的具体内容详见公司信息披露媒体《证券日报》、《证券时报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

12、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,《关于评估机构的独立性、评估假设前提的合理性、评估方法与评估目的的相关性及评估定价的公允性的议案》;

监事会认为本次拟收购刘雪楠、沈刚持有的北京康力优蓝机器人科技有限公司合计56%的股权的价格,参照北京天健兴业资产评估有限公司出具的《康力电梯股份有限公司拟收购北京康力优蓝机器人科技有限公司股权项目评估报告》所确定的评估值并经各方协商确定。

评估机构本次实际评估的资产范围与委托评估的资产范围一致;评估机构在评估过程中充分考虑了本次交易的目的和本次拟收购资产的业务特点和实际经营情况,采用的评估方法适当、评估假设前提合理;评估结果客观、公正反映了被评估对象的实际情况,评估结果具有公允性。

本次与交易对手协议确定的交易价格以评估值为依据,由各方在公平、自愿的原则下协商确定,资产定价公平、合理,符合相关法律、法规及《公司章程》的规定,不会损害公司及股东特别是中小股东的利益。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

13、会议以3票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司未来三年(2015-2017年)股东回报规划的议案》;

《公司未来三年(2015-2017年)股东回报规划》详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

特此公告。

康力电梯股份有限公司监事会

2015年9月1日

证券代码:002367 证券简称:康力电梯 公告编号:201533

康力电梯股份有限公司第三届董事会第十次会议决议的公告

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、董事会会议召开情况

康力电梯股份有限公司(以下简称"公司")第三届董事会第十次会议通知于2015年8月23日以邮件方式向全体董事发出,会议于2015年8月29日上午在公司会议室以现场与通讯相结合的方式召开,会期半天。本次董事会为临时董事会,会议应到董事7名,实到7名,其中,董事刘占涛先生以通讯方式出席本次会议。会议的召开和表决程序符合《公司法》、《公司章程》相关规定,公司监事、高级管理人员、中介机构列席了会议。本次会议由董事长王友林先生主持。经过全体董事审议,投票表决通过以下议案:

二、董事会会议审议情况

(一)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司符合非公开发行A股股票条件的议案》;

根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》等法律、法规和中国证券监督管理委员会颁布的《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司非公开发行股票实施细则》等规范性文件的有关规定,董事会通过对公司的实际经营情况和相关事项进行逐项对照审核后,认为公司符合现行法律法规关于非公开发行股票的规定,具备上市公司非公开发行股票的各项条件。

本议案事项尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(二)会议以6赞成,0票反对,0票弃权,逐项审议通过了《关于公司非公开发行A股股票方案的议案》,本议案涉及关联交易,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

同意公司本次非公开发行A股股票发行方案:

1、非公开发行股票的种类和面值

本次发行的股票为境内上市人民币普通股(A股)股票,每股面值为人民币1.00元。

2、发行方式

本次发行采用向特定对象非公开发行的方式进行,在中国证监会核准的有效期内选择适当时机向特定对象发行。

3、定价基准日、发行价格和定价原则

本次非公开发行股票发行价格不低于公司第三届董事会第十次会议决议公告日2015年9月1日(定价基准日)前20个交易日公司股票均价的90%,即18.50元/股(定价基准日前20个交易日股票交易均价=定价基准日前20个交易日股票交易总额/定价基准日前20个交易日股票交易总量)。具体发行价格将在公司取得发行核准批文后,根据竞价结果由公司董事会根据股东大会的授权与保荐机构(主承销商)协商确定。如公司股票在定价基准日至本次发行日期间发生除权、除息的,则本次非公开发行的发行底价将作相应调整。建信基金管理有限责任公司(代表"建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划")、刘雪楠和沈刚不参与本次发行定价的询价和竞价过程,但承诺接受其他发行对象申购竞价结果并与其他发行对象以相同价格认购本次发行的股份。

4、发行数量及认购方式

本次拟非公开发行的股票数量为不超过76,216,216股,若公司在本次发行定价基准日至发行日期间发生派息、送股、资本公积转增股本等除权、除息事项,本次非公开发行的数量将进行相应调整。

除刘雪楠和沈刚外,其余发行对象均以现金认购本次非公开发行的股份。刘雪楠和沈刚是北京康力优蓝机器人科技有限公司的股东,拟以其分别持有的康力优蓝21.4375%和6.5625%的股权认购康力电梯非公开发行的股份。

5、限售期

本次非公开发行A股股票完成后,建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划认购的股份自本次发行结束之日起36个月内不得转让;刘雪楠和沈刚认购的股份自本次发行结束之日起36个月内不得转让,并以《康力电梯股份有限公司与刘雪楠、沈刚关于北京康力优蓝机器人科技有限公司之股权转让协议》中相关约定为准;其他发行对象认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

6、滚存未分配利润的安排

本次非公开发行前的滚存未分配利润由本次非公开发行完成后的新老股东共享。

7、股票上市地点

本次非公开发行的股票在深交所上市。

8、募集资金数额及用途

本次非公开发行募集资金总额不超过141,000.00万元(含发行费用),扣除发行费用后,计划投资于以下项目:

序号	项目名称	投资总额	募集资金金额
1	康力优蓝服务机器人项目	48,960.00	48,960.00
2	基于物联网技术的智能电梯云服务平台项目	25,400.00	25,400.00
3	康力电梯智能制造工厂项目	40,707.36	38,500.00
4	康力电梯试验中心项目	32,100.00	24,000.00
合计		147,167.36	136,860.00

注:康力优蓝服务机器人项目分两部分完成,一是公司收购康力优蓝56%的股权,金额为8,960万元,其中以股票支付对价4,480万元,以非公开发行募集的现金支付对价4,480万元;二是以本次非公开发行募集资金向康力优蓝进行增资,增资金额为40,000万元。

在本次非公开发行募集资金到位之前,公司将根据项目进度的实际情况以自筹资金先行投入,并在募集资金到位后予以置换。若本次募集资金净额少于上述项目拟投入募集资金总额,公司将根据实际募集资金数额,按照项目的轻重缓急等情况,调整并最终决定募集资金投入的优先顺序及各项目的具体投资额,募集资金不足部分由公司以自有资金解决。

9、决议有效期

本次发行决议自公司股东大会审议通过之日起十二个月内有效。如果公司已于该有效期内取得中国证监会对本次非公开发行股票的核准文件,则本决议有效期自动延长至本次非公开发行股票完成日。

独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年度第一次临时股东大会逐项审议通过,并经中国证监会核准后方可实施,最终以中国证监会核准的方案为准。

(三)会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司本次非公开发行A股股票预案的议案》,本议案涉及关联交易,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

《关于公司本次非公开发行A股股票预案》、独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(四)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司本次非公开发行A股股票募集资金使用可行性分析报告的议案》;

《公司非公开发行A股股票募集资金使用可行性分析报告》详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(五)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司前次募集资金使用情况报告的议案》;

根据《公司法》、《证券法》以及中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《关于前次募集资金使用情况报告的规定》等有关法律、法规的规定,公司董事会针对前次募集资金的使用情况编制了专项报告。

《董事会关于前次募集资金使用情况的报告》、独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(六)逐项审议通过了《关于公司与特定对象签署附条件生效的股份认购合同的议案》;

根据本次非公开发行方案,公司分别与建信基金管理有限责任公司(代表"建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划")、刘雪楠和沈刚签署了附生效条件的《股份认购合同》。

该合同在本次非公开发行股票获得公司董事会、股东大会审议通过且获得中国证监会核准后生效。本议案逐项审议如下:

1、会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了公司与建信基金管理有限责任公司(代表"建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划")签署的附条件生效的《股份认购合同》,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

2、会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了公司与刘雪楠签署的附条件生效的《股份认购合同》;

3、会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了公司与沈刚签署的附条件生效的《股份认购合同》。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(七)、会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司与刘雪楠、沈刚关于北京康力优蓝机器人科技有限公司之股权转让协议的议案》,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

公司以部分本次非公开发行的股票和部分本次非公开发行募集的资金收购刘雪楠、沈刚持有的北京康力优蓝机器人科技有限公司合计56%的股权。

独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(八)会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司对子公司北京康力优蓝机器人科技有限公司进行增资的议案》,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(九)、会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司与王友林签署附条件生效的股份对价支付合作协议的议案》,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十)会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司本次非公开发行A股股票涉及关联交易事项的议案》,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

《关于公司本次非公开发行A股股票涉及关联交易事项的公告》、独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十一)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于批准本次非公开发行股票募集资金拟收购标的资产相关审计报告、评估报告的议案》;

相关审计报告、评估报告的具体内容详见公司信息披露媒体《证券日报》、《证券时报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十二)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于评估机构的独立性、评估假设前提的合理性、评估方法与评估目的的相关性及评估定价的公允性的议案》;

本次拟收购刘雪楠、沈刚持有的北京康力优蓝机器人科技有限公司合计56%的股权的价格,参照北京天健兴业资产评估有限公司出具的《康力电梯股份有限公司拟收购北京康力优蓝机器人科技有限公司股权项目评估报告》所确定的评估值并经各方协商确定。

评估机构本次实际评估的资产范围与委托评估的资产范围一致;评估机构在评估过程中充分考虑了本次交易的目的和本次拟收购资产的业务特点和实际经营情况,采用的评估方法适当、评估假设前提合理;评估结果客观、公正反映了被评估对象的实际情况,评估结果具有公允性。

本次与交易对手协议确定的交易价格以评估值为依据,由各方在公平、自愿的原则下协商确定,资产定价公平、合理,符合相关法律、法规及《公司章程》的规定,不会损害公司及股东特别是中小股东的利益。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十三)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于公司未来三年(2015-2017年)股东回报规划的议案》;

《公司未来三年(2015-2017年)股东回报规划》、独立董事就该事项发表的意见,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十四)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于修订<股东大会议事规则>的议案》;

《股东大会议事规则》,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十五)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于修订<募集资金专项管理制度>的议案》;

《募集资金专项管理制度》,详见巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十六)会议以6票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于提请股东大会授权董事会全权办理本次非公开发行股票相关事宜的议案》,董事长王友林先生作为关联董事回避表决;

为保证本次非公开发行有序、顺利推进和实施,根据法律、法规和《公司章程》的有关规定,董事会提请股东大会授权董事会全权办理本次非公开发行股票的相关事宜,包括但不限于:

1、根据市场情况制定和实施本次非公开发行股票的具体方案,包括但不限于发行起止时间、发行数量、定价方式、发行价格、认购方式、发行对象以及其他与发行和上市有关的事宜;

2、如监管部门对非公开发行的政策发生变化或市场条件发生变化,授权董事会在股东大会通过的发行方案范围之内对本次非公开发行的具体方案等进行相应调整;

3、聘请与本次发行相关的中介机构,批准、签署与本次非公开发行及股份认购有关的各项文件;

4、办理本次非公开发行股票申报事项并根据审批机关要求对申报文件进行相应补充或调整;

5、为本次募集资金开立募集资金专户;

6、根据本次非公开发行股票结果,修改《公司章程》相应条款、办理工商变更登记等事宜;

7、在本次非公开发行完成后,办理本次非公开发行的股票在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司和深圳证券交易所的登记、上市和锁定等事宜;

8、根据本次募集资金投资项目情况、市场情况和公司经营情况等因素,在法律、法规及规范性文件和《公司章程》及股东大会决议允许的范围内,对募集资金投资项目具体安排进行适当调整;

9、办理与本次非公开发行股票有关的其他事项;

10、本授权自股东大会审议通过之日起12个月内有效。如果公司已于该有效期内取得中国证监会对本次非公开发行股票的核准文件,则本决议有效期自动延长至本次非公开发行股票完成日。

本议案尚须提交公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

(十七)会议以7票赞成,0票反对,0票弃权,审议通过了《关于提请召开2015年第一次临时股东大会的议案》。

具体通知、内容详见公司信息披露媒体《证券日报》、《证券时报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)。

三、备查文件

1、经与会董事签字并加盖董事会印章的第三届董事会第十次会议决议;

2、天衡会计师事务所(特殊普通合伙)出具的《康力电梯股份有限公司前次募集资金使用情况鉴证报告》;

3、北京天健兴业资产评估有限公司关于北京康力优蓝机器人科技有限公司的评估报告;

4、董事会审计委员会关于关联交易的审核意见;

5、独立董事关于关联交易事前认可意见;

6、独立董事关于第三届董事会第十次会议相关事项的独立意见;

7、康力电梯股份有限公司与刘雪楠、沈刚签署的《康力电梯股份有限公司与刘雪楠、沈刚关于北京康力优蓝机器人科技有限公司之股权转让协议》;

8、康力电梯股份有限公司与建信基金管理有限责任公司(代表"建信康力投资1号特定多个客户资产管理计划")、刘雪楠和沈刚分别签署的附条件生效的《股份认购合同》;

9、康力电梯股份有限公司与王友林签署的《康力电梯股份有限公司与王友林股份对价支付合作协议》。

特此公告。

康力电梯股份有限公司董事会

2015年9月1日

(上接B66版)

八、基金的投资策略

本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下,依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期,综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。

1、资产配置策略

(1)整体配置策略

根据对利率水平、GDP、CPI、PPI、货币供应量、国际利率水平、汇率等宏观经济指标和宏观调控政策的分析,决定基金投资组合的剩余期限及期限分布结构。

(2)类别资产配置策略

根据不同类别资产的收益率水平(各剩余期限到期收益率、利息支付方式和再投资便利性),并结合各类资产的流动性特征(日均成交量、交易方式、市场流量)和风险特征(信用等级、波动性),决定各类资产的配置比例和期限匹配量。

(3)明细资产配置策略

根据明细资产的信用等级、剩余期限和流动性(日均成交量和平均每笔成交间隔时间)进行初步筛选;根据明细资产的收益率与剩余期限的结构合理性,决定其投资价值,进行再次筛选;根据明细资产的到期收益率波动性与可投资量(流通量、日均成交量与冲击成本估算),决定具体投资量。

2、交易策略

本基金通过研判货币市场利率趋势、货币供求关系和各短期金融工具相对收益期限结构状况,在有效控制流动性风险的基础上,贯彻实施以下投资策略:

(1)货币市场利率预期策略

通过宏观经济形势、财政货币政策和短期资金供求状况的深入分析,对短期利率走势进行合理预估,并据此实施以调整基金组合平均到期期限为主的资产配置策略。当预期短期利率呈下降趋势时,侧重配置期限稍长的短期金融工具;反之,则侧重配置期限较短的金融工具。

(2)资产动态优化配置策略

在对利率趋势、各短期金融工具的市场规模、流动性以及与其期限相对应的预期收益率进行深入研判的基础上,在流动性要求约束下,以收益最大化为目标,建立动态规划模型,对类属资产配置比例以及类属资产内部不同期限结构品种的配置比例进行优化。

(3)套利策略

不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素差异化影响而出现定价差异,从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上,适度进行跨市场或跨品种套利操作,提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利,期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作(跨期限套利)。

(4)峰值策略

把握资金供求的瞬时效应,积极捕捉收益率峰值的短线机会。如新股发行期间、年末资金回笼时期的季节效应等短期资金供求失衡,导致回购利率突增等。

(5)现金流均衡管理策略

通过对基金申购、赎回现金流的预测,在投资组合的构建中,对各投资品种的剩余期限搭配进行合理布局。例如,为满足日常的较稳定的现金流变现需要,可采纳相同品种(如回购等)的滚动投资策略,即采用均分资金量、持续滚动投资的方法,使得该品种自然到期兑现的现金流在时间上均匀化。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:同期7天通知存款利率(税后),即(1-利息税率)×同期7天通知存款利率。

通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期7天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

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比较基准时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,564,812,990.53	40.72
	其中:债券	3,564,812,990.53	40.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,476,296,774.43	39.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,613,907,474.06	18.44
4	其他资产	98,416,237.10	1.12
5	合计	8,753,433,476.12	100.00

2、报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0.40
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

注:本基金基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2015年06月19日	122.00	因为赎回,基金规模缩小,导致资产组合剩余期限被动超过120天	2
2	2015年06月20日	121.00	因为赎回,基金规模缩小,导致资产组合剩余期限被动超过120天	1
3	2015年06月24日	130.00	因为赎回,基金规模缩小,导致资产组合剩余期限被动超过120天	1

(2)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	48.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	9.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	22.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	9.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.93	-

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	502,097,952.91	5.74
	其中:政策性金融债	502,097,952.91	5.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,062,715,037.62	35.01
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,564,812,990.53	40.75
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150211	15国开11	2,000,000	200,884,446.65	2.30
2	011515004	15中建材SCP005	2,000,000	200,232,267.55	2.29
3	011586006	15光明SCP006	1,700,000	169,963,031.31	1.94
4	011581003	15淮南矿SCP003	1,600,000	159,953,845.82	1.83
5	071507003	15中信建投CP003	1,500,000	149,973,659.03	1.71
6	011599366	15首旅SCP004	1,500,000	149,862,557.58	1.71
7	011589001	15鞍钢股SCP001	1,400,000	140,123,164.45	1.60
8	041461041	14潍坊滨投CP001	1,300,000	130,036,070.00	1.49
9	150206	15国开06	1,000,000	100,940,798.24	1.15
10	140230	14国开30	1,000,000	100,484,710.29	1.15

6、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	23
报告期内偏离度的最高值	0.3671%
报告期内偏离度的最低值	0.1040%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2217%

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十名资产支持证券投资明细

本基金本期末未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注

(1)基金计价方法说明。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

(2)本基金本报告期内无剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

(3)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

(4)其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	63,860,135.94
4	应收申购款	34,556,101.16
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	98,416,237.10

(5)本基金本期末投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

十二、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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金净值表现详见下表:

国投瑞银货币市场基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表(截止2015年6月30日)

	阶段	净值收益率①	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
A级	2009.01.19至2009.12.31	0.9336%	0.0039%	1.3097%	0.0000%	-0.3761%	0.0039%
	2010.01.01至2010.12.31	1.7642%	0.0039%	1.3781%	0.0000%	0.3861%	0.0039%
	2011.01.01至2011.12.31	3.3914%	0.0047%	1.4909%	0.0001%	1.9005%	0.0046%
	2012.01.01至2012.12.31	4.0836%	0.0049%	1.4478%	0.0002%	2.6358%	0.0047%
	2013.01.01至2013.12.31	3.9068%	0.0031%	1.3781%	0.0000%	2.5287%	0.0031%
	2014.01.01至2014.12.31	4.4529%	0.0051%	1.3781%	0.0000%	3.0748%	0.0051%
	2015.01.01至2015.3.31	1.0429%	0.0023%	0.3381%	0.0000%	0.7048%	0.0023%
	2015.04.01至2015.6.30	0.8908%	0.0049%	0.3418%	0.0000%	0.5490%	0.0049%
	自基金合同生效至今	22.2980%	0.0054%	9.4213%	0.0001%	12.8767%	0.0053%
B级	2009.01.19至2009.12.31	1.1647%	0.0040%	1.3097%	0.0000%	-0.1450%	0.0040%
	2010.01.01至2010.12.31	2.0099%	0.0039%	1.3781%	0.0000%	0.6318%	0.0039%
	2011.01.01至2011.12.31	3.6396%	0.0047%	1.4909%	0.0001%	2.1487%	0.0046%
	2012.01.01至2012.12.31	4.3340%	0.0049%	1.4478%	0.0002%	2.8862%	0.0047%
	2013.01.01至2013.12.31	4.1570%	0.0031%	1.3781%	0.0000%	2.7789%	0.0031%
	2014.01.01至2014.12.31	4.7041%	0.0051%	1.3781%	0.0000%	3.3260%	0.0051%
	2015.01.01至2015.3.31	1.1036%	0.0023%	0.3381%	0.0000%	0.7655%	0.0023%
	2015.04.01至2015.6.30	0.9512%	0.0049%	0.3418%	0.0000%	0.6094%	0.0049%
	自基金合同生效至今	24.2090%	0.0054%	9.4213%	0.0001%	14.7877%	0.0053%

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金的业绩比较基准中,通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期7天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。根据财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知(财税[2008]132号)文件规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。故本基金本报告期以税前七天通知存款利率为业绩比较基准。

十三、费用概览

(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)基金销售服务费;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)基金的证券交易费用;

(8)基金的银行汇划费用;

(9)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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、公休假等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)基金销售服务费

本基金A级基金份额的销售服务费年费率为0.25%,B级基金份额的销售服务费年费率为0.01%。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×R÷当年天数

H为每日该级基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该级基金份额的基金资产净值

R为该级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金注册登记机构,由基金注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)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;

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《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、信息披露费用等费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,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前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费与赎回费用

本基金不收取申购费用与赎回费用。

2、本基金的转换费用

投资者可以选择在本基金和本基金管理人管理的其他基金之间进行转换,转换业务的具体开办时间和转换规则请参见基金管理人发布的基金转换公告。

(三)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、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》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《货币市场基金管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)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2015年3月3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及投资组合报告的截止日期。

2、在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人的信息。

3、在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关内容。

4、在"五、相关服务机构"部分,更新了原有销售机构的信息,增加了新增代销机构的概况。

5、在"九、基金的投资"部分,更新了本基金最近一期投资组合报告内容。

6、在"十一、基金的业绩"部分,更新了基金合同生效以来的投资业绩。

7、"二十三、其他应披露事项"部分,更新了本报告期内涉及本基金的相关公告以及其他应披露事项。

上述内容仅为本基金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详细内容,可登录国投瑞银基金管理有限公司网站www.ubssdic.com。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一五年九月一日