安信现金增利货币市场基金更新招募说明书摘要

（2015年第2号）

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

本招募说明书（更新）摘要内容截止日：2015年11月24日

重要提示

安信现金增利货币市场基金（以下简称“本基金”）于2014年7月15日经中国证监会证监许可[2014]704号文准予募集注册。本基金基金合同于2014年11月24日正式生效。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。本基金为货币市场基金，投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2015年5月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：安信基金管理有限责任公司
住所：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人：牛冠兴
成立时间：2011年12月6日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监许可〔2011〕1895号
组织形式：有限责任公司
注册资本：35,000万元人民币
存续期间：永续经营
联系人：王阳
联系电话：0755-82509999
公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
五矿资本控股有限公司	38.72%
安信证券股份有限公司	33%
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	19.71%
中广核财务有限责任公司	8.57%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

牛冠兴先生，董事长，经济学硕士。历任武汉市人民银行硚口支行信贷员，武汉市工商银行古田办事处主任，武汉市工商银行江岸支行行长，武汉市工商银行副行长，招商银行总行信贷部总经理，招商证券股份有限公司总经理，招商基金管理有限公司董事长，南方证券行政接管组及广东证券托管组组长，安信证券股份有限公司董事长，前海股权交易中心（深圳）有限公司监事会主席。现任中证信用增进股份有限公司董事长、安信基金管理有限责任公司董事长、安信国际金融控股有限公司董事、中国证券业协会副会长。

李军先生，董事，经济学硕士。历任深圳市罗湖工业研究所经理，深圳证券电脑公司经理，深圳证券交易所人事部助理总监、西南中心主任、上市审查部副总监、市场监察部副总监、会员管理部副总监，中国科技证券有限责任公司托管组组长。现任安信证券股份有限公司副总裁，安信乾宏投资有限公司董事长。

刘人领先生，董事，经济学博士。历任国通证券股份有限公司（现招商证券股份有限公司）研究发展中心总经理助理、人力资源部总经理助理；招商证券股份有限公司战略部副总经理（主持工作）、总裁办公室主任、理财客户部总经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理兼办公室主任、总裁助理兼营销服务中心总经理、总裁助理兼安信期货有限责任公司董事长、总裁助理兼资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事长。

任珠峰先生，董事，经济学博士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员、有色部经理、上海公司副总经理，英国金属矿产有限公司小有色、铁合金及矿产部经理，五矿投资发展有限责任公司资本运营部总经理、五矿投资发展有限责任公司副总经理。现任中国五矿集团公司总经理助理、中国五矿集团公司金融业务中心总经理、五矿资本控股有限公司董事、总经理和党委书记、五矿集团财务有限责任公司董事长、五矿资本（香港）有限公司董事长、五矿国际信托有限公司董事长、五矿证券有限公司董事长、五矿经易期货有限公司董事长、隆茂投资有限公司副董事长、中国外贸金融租赁有限公司副董事长、工银安盛人寿保险有限公司副董事长、中国五金制品有限公司董事、青海中地矿资源开发有限公司执行董事。

王晓东先生，董事，经济学硕士。历任中国五金矿产进出口总公司财务部科员，日本五金矿产株式会社财务部科员，中国外贸金融租赁有限公司副总经理，中国五矿集团公司财务总部副总经理。现任五矿资本控股有限公司副总经理及资本运营部总经理、五矿鑫扬（上海）投资管理有限公司董事长、五矿国际信托有限公司董事、五矿证券有限公司董事、五矿经易期货有限公司董事、五矿金牛进出口贸易（上海）有限公司执行董事。

李宏蕾先生，董事，会计硕士。历任深圳华强集团有限公司财务结算中心投融资经理，中广核财务有限责任公司信贷业务高级经理、总经理部秘书和投资银行业务高级经理，中国广核集团有限公司资本运营与产权管理部资本运营主任。现任中广核财务有限责任公司投资银行部副总经理（主持工作）。

徐景安先生，独立董事，1964年毕业于复旦大学新闻学专业。历任中央马列主义研究院干部，中共中央政策研究室干部，北京军区炮兵政治部教员，国家计划委员会研究室科长，国务院经济体制改革办公室科长，国家经济体制改革委员会处长，中国经济体制改革研究会副所长，深圳市经济体制改革委员会主任，深圳市土必达国际投资公司董事长，深圳市徐景安投资顾问公司董事长。现任深圳市景安文化传播公司董事长。

郑斌先生，独立董事，法学硕士。历任中央组织部干部，国家国有资产管理局综合司副处长，北京市正平律师事务所主任。现任北京市金诚同达律师事务所高级合伙人。

庞继英先生，独立董事，金融学博士，高级经济师。历任中央纪律检查委员会干部，国家外汇管理局副处长、处长、副司长，中国外汇交易中心副总裁、总裁，中国人民银行条法司副司长、金融稳定局巡视员，中国再保险（集团）股份有限公司党委副书记、副董事长。现任国家开发银行股份有限公司董事。

2、基金管理人监事会成员

王晓荷女士，监事会主席，经济学硕士。曾任中国证券监督管理委员会干部。现任安信证券股份有限公司监事会主席。

刘国威先生，监事，工商管理硕士。历任五矿集团财务有限责任公司资金部副经理、经理，香港企荣财务有限公司资金部高级经理，五矿投资发展有限责任公司综合管理部副总经理、规划发展部总经理、资本运营部总经理，中国五矿集团公司金融业务中心资本运营部总经理兼五矿投资发展有限责任公司纪委委员。现任中国五矿集团公司金融业务中心副总经理兼五矿资本控股有限公司副总经理、五矿资本（香港）有限公司董事、隆茂投资有限公司董事，中国外贸金融租赁有限公司董事、五矿证券有限公司董事、工银安盛人寿保险有限公司监事。

廖维坤先生，职工监事，理学学士。历任轻工业部南宁设计院电算站软件工程师，中银万国证券股份有限公司深圳营业部电脑主管，南方证券股份有限公司深圳管理总部电脑工程师、布吉营业部营业部副总经理、稽核总部高级经理、经纪业务总部高级经理、债券基金部执行经理，南方证券行政接管组成员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组副组长，安信基金管理有限责任公司督察长。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事、总经理。

李学明先生，副总经理，哲学硕士。历任招商证券股份有限公司总裁办公室高级经理，理财发展部高级经理；安信证券股份有限公司人力资源部总经理助理、副总经理，安信基金筹备组成员；安信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场部总经理。现任安信基金管理有限责任公司副总经理，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

乔江辉女士，督察长，文学学士。历任中华人民共和国公安部科长、副处长，安信证券股份有限公司安信基金筹备组成员，安信基金管理有限责任公司总经理助理兼北京分公司总经理。现任安信基金管理有限责任公司督察长，兼任安信乾盛财富管理（深圳）有限公司董事。

4、本基金基金经理

张翼飞先生，经济学硕士。历任摩根轧机（上海）有限公司财务部会计、财务主管，上海市国有资产监督管理委员会规划发展处研究员，秦皇岛嘉隆高科实业有限公司财务总监，日盛嘉富证券国际有限公司上海代表处研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。2014年3月26日至今，任安信现金管理货币市场基金的基金经理；2014年11月24日至今，任安信现金增利货币市场基金的基金经理；2015年5月25日至今，任安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

主任委员：

刘人领先生，董事，总经理，经济学博士。简历同上。

委员：

姜诚先生，经济学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司资产委托管理总部助理研究员、研究员、投资经理，安信基金管理有限责任公司研究部总经理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理。

李勇先生，经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。

龙川先生，统计学博士。历任Susquehanna International Group（美国）量化投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部首席研究员、东方证券资产管理有限公司量化投资部总监。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。

陈一峰先生，经济学硕士，注册金融分析师(CFA)。历任国泰君安证券股份有限公司资产管理总部助理研究员，安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。

占冠良先生，管理学硕士。历任招商证券股份有限公司研究部研究员，大成基金管理有限公司研究部研究员、投资部基金经理，南方基金管理有限公司专户投资管理部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司研究部总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：刘士余
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营，可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理业务管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行证券投资业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

截止到2015年9月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共306只。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：安信基金管理有限责任公司
住所：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈思伶
电话：0755-82509820
传真：0755-82509920
客户服务电话：4008-088-088
公司网站：www.essencefund.com

2、销售机构

安信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
客户服务电话：400-800-1001
网址：www.essence.com.cn

（二）基金份额登记机构

名称：安信基金管理有限责任公司
住所：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址：广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人：牛冠兴
联系人：林葛
电话：0755-82509865
传真：0755-82560289

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号19楼
办公地址：上海市银城中路68号19楼
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：黎明
经办律师：黎明、孙睿

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法定代表人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：（010）58153000、（0755）25028288
传真：（010）85188298、（0755）25026188
签章注册会计师：张小东、陈立群
联系人：李妍明

四、基金名称

安信现金增利货币市场基金

五、基金类型

货币型

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、投资目标

在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人创造稳定的收益。

八、投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在397天以内（含397天）的债券、剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的规定）。

未来若法律法规或监管机构允许货币市场基金投资同业存单的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下，本基金可参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

九、投资策略

1、资产配置策略

本基金通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析，形成对宏观层面的判断。同时，结合对央行公开市场操作、债券供给等情况，对短期利率走势进行综合判断。基于对货币市场利率趋势变化的合理预测，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。

此外，通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析，确定本基金流动性目标，相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比。结合各类资产的收益率水平、流动性特征、信用风险等因素来确定并动态调整投资组合中央行票据、国债、债券回购等投资品种各类属品种的配置比例，以满足投资人对基金流动性的需求，并达到获取投资收益的目的。

2、个券选择策略

本基金将首先考虑安全性因素，优先选择国债、央行票据等高信用等级的债券品种以规避信用风险。同时，在满足信用评级要求的前提下，根据基金管理人制订的债券评分标准对企业债、金融债等信用债券进行评分筛选。符合标准的个券，将进入备选池，通过收益率拟合，找出收益率明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，该券种价格出现低估，本基金将对此类低估值品种进行重点关注。

3、套利策略

由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异、资金供求失衡、流动性等因素造成不同交易市场或不同交易品种出现定价差异现象，从而使债券市场上存在套利机会。在保证安全性和流动性的前提下，本基金将在充分验证这种套利机会可行性的基础上，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，以获取安全的超额收益。

4、回购策略

在有效控制风险的条件下，本基金将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。当债券回购利率低于债券收益时，通过循环回购以放大债券投资收益。同时，密切关注由于新股申购、增发等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。

5、流动性管理策略

本基金作为现金管理工具，必须保持较高的流动性。在遵循流动性优先的原则下，本基金将建立流动性预警指标，动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例。同时，密切关注本基金申购/赎回、季节性资金流动等情况，适时通过现金留存、提高流动性券种比例等方式提高基金资产整体的流动性，以确保基金资产的整体变现能力。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

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可支取的存款，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。根据基金的投资范围、投资目标及流动性特征，选取同期七天通知存款利率（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，或者证券市场中有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须报中国证监会备案并及时公告，而无须基金份额持有人大会审议。

十一、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，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金

十二、基金投资组合报告

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。

本基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，来源于《安信现金增利货币市场基金2015年第3季度报告》。本报告中所列财务数据未经审计。

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	固定收益投资	109,636,503.22	63.33
	其中：债券	109,636,503.22	63.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	61,663,927.73	35.62
4	其他资产	1,828,270.19	1.06
5	合计	173,128,701.14	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	11.20
	其中：买断式回购融资	-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2015年8月5日	21.34	巨额赎回	2天
2	2015年8月6日	20.61	巨额赎回	1天
3	2015年8月20日	21.21	巨额赎回	1天
4	2015年8月25日	20.60	巨额赎回	3天
5	2015年8月26日	24.60	巨额赎回	2天
6	2015年8月27日	25.64	巨额赎回	1天

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	129
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	138
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况，但根据本基金基金合同的约定，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。

（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	34.71	16.03
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	26.78	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	4.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	7.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	41.80	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.05	16.03

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	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,395,402.92	19.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,004,303.16	6.72
	其中：政策性金融债	10,004,303.16	6.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,236,797.14	47.17
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	109,636,503.22	73.63
10	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序的前十名债券投资明细

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	019822	08国债22	174,800	17,488,977.25	11.75
2	041559024	15耀皮CP002	100,000	10,090,400.01	6.78
3	041558036	15沈公用CP002	100,000	10,088,975.15	6.78
4	041559046	15新投CP001	100,000	10,070,488.22	6.76
5	130326	13进出26	100,000	10,004,303.16	6.72
6	011599417	15厦路桥SCP003	100,000	9,998,132.06	6.71
7	011519006	15国电SCP006	100,000	9,997,960.90	6.71
8	011599421	15津渤海SCP001	100,000	9,997,451.17	6.71
9	041555037	15华电煤业CP001	100,000	9,993,389.63	6.71
10	019428	14国债28	65,270	6,539,731.13	4.39

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	7
报告期内偏离度的最高值	0.2852%
报告期内偏离度的最低值	0.0319%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1389%

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。

8、投资组合报告附注

（1）本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

（2）本报告期内本基金不存在持有剩余期限小于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20%的情况。

（3）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,188.12
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,819,082.07
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,828,270.19

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及其更新。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2014.11.24-2014.12.31	0.4914%	0.0079%	0.1405%	0.0000%	0.3509%	0.0079%
2015.1.1-2015.9.30	3.0031%	0.0338%	1.0097%	0.0000%	1.9934%	0.0338%

十四、基金的费用与税收

(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、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、律师费和诉讼费；
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。

（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0.33%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5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0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.08%÷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5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

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第4－9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；
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）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。

十五、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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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要求，对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、对“重要提示”部分进行了更新。

2、“第三部分 基金管理人”部分，更新基金管理人概况、董事会成员、监事会成员、本基金基金经理以及投资决策委员会成员信息，本基金基金经理未发生变更。

3、“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人基本情况、主要人员情况和基金托管业务经营情况。

4、“第五部分 相关服务机构”部分，更新基金份额登记机构的信息。

5、“第九部分 基金的投资”部分，更新基金投资组合报告的内容。

6、更新“第十部分 基金的业绩”部分的内容。

7、更新“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”部分的内容。

8、更新“第二十二部分 其他应披露的事项”部分的内容。

安信基金管理有限责任公司
2015年12月

安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持碧水源（300070）估值调整的公告

鉴于碧水源股票因重大事项连续停牌，为使本基金管理人旗下相关基金的估值公平、合理，根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》([2008]38 号公告)的要求，经与托管行和会计师事务所协调一致，安信基金管理有限责任公司决定自2015年12月22日起对公司旗下基金持有的碧水源股票按指数收益法进行调整。

待上述股票复牌且交易体现活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

投资者可登陆基金管理人网站（www.essencefund.com）或拨打客户服务电话4008-088-088咨询有关信息。

安信基金管理有限责任公司
2015年12月23日

股票代码：000726 200726　股票简称：鲁泰A 鲁泰B　公告编号：2015-054

鲁泰纺织股份有限公司关于召开2015年第三次临时股东大会通知的提示性公告

公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

根据公司第七届董事会第二十八次会议决议，公司定于2015年12月29日召开2015年第三次临时股东大会，公司董事会已于2015年12月10日在《证券时报》、《上海证券报》、《大公报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）刊登了《关于召开2015年第三次临时股东大会的通知》，现将会议有关事项提示公告如下：

一、召开会议基本情况：

1、股东大会的届次：本次股东大会为2015年第三次临时股东大会。

2、股东大会的召集人：本次股东大会的召集人为公司董事会，2015年12月8日公司召开了七届二十八次董事会，审议通过了召开本次股东大会的议案。

3、会议召开的合法、合规性：本次会议由公司董事会召集，召开程序符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。

4、会议召开的方式：本次会议采用现场投票和网络投票相结合的方式召开。本次股东大会提供网络投票方式，公司将通过深交所交易系统和互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn）向全体股东提供网络形式的投票平台，股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

5、会议召开的时间：现场会议时间：2015年12月29日（星期二）下午14：30时。网络投票时间：交易系统投票时间：2015年12月29日上午9:30至11:30，下午13:00至15:00；互联网投票系统开始投票的时间为2015年12月28日下午15：00，结束时间为2015年12月29日下午15：00。

同一表决权只能选择现场、网络表决方式或其他表决方式中的一种。同一表决权出现重复表决的以第一次投票结果为准。

6. 出席对象：

（1）本次股东大会的股权登记日：2015年12月21日，截止2015年12月21日下午3:00收盘后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的公司全体股东，均有权出席股东大会（B股投资者应在股权登记日之前的第3个交易日或更早买入公司股票方可参会）。因故不能出席会议的股东，可以书面形式委托代理人出席会议和参加表决，该股东代理人不必是本公司股东。

（2）公司董事、监事和高级管理人员。

（3）公司聘请的见证律师。

7. 会议地点：

现场会议的地点：鲁泰纺织股份有限公司般阳山庄会议室。

二、会议审议事项

1、审议《关于同意控股子公司新疆鲁泰丰收棉业有限责任公司为其全资子公司新疆鲁泰纺织有限公司向中国农业银行阿瓦提县支行申请银行借款提供1亿元担保的议案》。

三、股东大会登记方法：

1、出席现场会议登记方式：参加本次股东大会现场会议的股东，请持本人身份证、股东账户卡、持股清单等股权证明到公司登记；委托代理人持本人身份证、授权委托书、委托人股东账户卡、委托人身份证及委托人持股清单到公司登记；法人股东持营业执照复印件、法人授权委托书、出席人身份证到公司登记。异地股东可用传真或信函登记，传真、信函以登记时间内公司收到为准。

2、出席现场会议登记时间：2015年12月25日、28日（上午8:00-11:30,下午14:00-17:00）。

3、登记地点：公司证券部

联系电话：（0533）5285166
传真：（0533）5282188-234　（0533）5418805
联系人：秦桂玲、郑卫印、李琨

4、委托表决权人登记和表决时应提交的文件：委托代理人本人身份证、委托人签署的授权委托书、委托人股东账户卡、委托人身份证及委托人持股清单。

四、参与网络投票的股东投票程序

对于本次股东大会审议的议案，公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向流通股股东提供网络形式的投票平台，公司股东可以通过交易系统或互联网投票系统参加网络投票。

（一）采用交易系统投票的投票程序

1、投票代码：360726
2、证券简称：鲁泰投票
3、投票时间：2015年12月29日的交易时间，即上午9:30 -11:30，下午13:00 -15:00。
4、在投票当日，“鲁泰投票”“昨日收盘价”显示的数字为本次股东大会审议的议案总数。
5、通过交易系统进行网络投票的操作程序

（1）进行投票时买卖方向应选择“买入”。

（2）在“委托价格”项下填报股东大会议案序号。100.00元代表总议案，1.00元代表议案1，2.00元代表议案2，以此类推。每一议案应以相应的委托价格分别申报。

对于逐项表决的议案，如议案1中有多个需表决的子议案，1.00元代表对议案1下全部子议案进行表决，1.01元代表议案1中子议案①，1.02元代表议案1中子议案②，依此类推。

表1　股东大会议案对应“委托价格”一览表

议案序号	议案名称	委托价格
总议案	对所有议案表决	100.00
议案1	关于同意控股子公司新疆