（上接B101版）

(25)中国中投证券有限责任公司

注册地址:	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:	龙增来
联系人:	刘毅
电话:	0755-82023442
传真:	0755-82026539
客户服务电话:	4006008008
网址:	http://www.cjis.cn/

(26)国金证券股份有限公司

注册地址:	四川省成都市东城根上街95号
办公地址:	四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:	冉云
联系人:	刘一宏
电话:	028-86690070
传真:	028-86690126
客户服务电话:	4006-600109
网址:	http://www.gjzq.com.cn

2. 二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3. 基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

二、登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电 话:0755-25946013

传 真:0755-25987122

联系人:严峰

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号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

电话:021- 31358666

传真:021- 31358600

联系人:安冬

经办律师:吕红、安冬

四、审计基金财产的会计师事务所

机构名称: 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址: 上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

电话: 021-23238888

传真: 021-23238800

经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

联系人:沈兆杰

一、基金的名称

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

二、基金的类型

本基金为交易型开放式指数证券投资基金

三、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

四、投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。

为了更好地实现投资目标，本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

五、投资策略

本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。

同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。

为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

六、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标普500指数（S&P 500 Index（NTR，Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）。

七、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。

本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。

基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	187,953,739.89	94.65
	其中：普通股	182,967,915.44	92.14
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	4,985,824.45	2.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,987,257.22	5.03
8	其他各项资产	644,497.38	0.32
9	合计	198,585,494.49	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值（人民币元）	公允价值变动（人民币元）
股指期货	ESZ5	S&P500 EMINI FUT Dec15	15	9,106,359.98	-160,018.50
总额合计					-160,018.50
减：可抵消期货暂收款					-160,018.50
股指期货投资净额					0.00

2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	187,953,739.89	94.81
合计	187,953,739.89	94.81

3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	31,072,749.41	15.67
医疗保健	27,575,533.15	13.91
非日常生活消费品	24,606,953.90	12.41
工业	18,908,186.91	9.54
日常消费品	18,667,482.36	9.42
能源	13,016,834.05	6.57
公用事业	5,912,349.78	2.98
原材料	5,284,162.00	2.67
信息技术	38,358,826.07	19.35
电信业务	4,550,662.26	2.30
合计	187,953,739.89	94.81

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	-	AAPL US	NYSE	美国	9,960.00	6,988,447.84	3.53
2	ALPHABET INC	-	GOOG US	NYSE	美国	516.00	1,997,096.55	1.01
			GOOGL US	NYSE	美国	506.00	2,054,796.72	1.04
3	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	NYSE	美国	13,968.00	3,932,706.30	1.98
4	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	NYSE	美国	7,282.00	3,444,114.05	1.74
5	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	NYSE	美国	4,837.00	2,872,342.92	1.45
6	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	NYSE	美国	17,632.00	2,828,736.78	1.43
7	BERKSHIRE HATH-AWAY INC-CL B	-	BRK/B US	NYSE	美国	3,271.00	2,713,338.72	1.37
8	WELLS FARGO & CO	-	WFC US	NYSE	美国	8,159.00	2,665,159.83	1.34
9	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	NYSE	美国	6,459.00	2,505,113.21	1.26
10	FACEBOOK INC-A	-	FB US	NYSE	美国	3,946.00	2,256,641.91	1.14

注：以上证券代码使用当地代码

5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
-	期货投资	S&P500 EMINI FUT Dec15	-160,018.50	-0.08

9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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10 投资组合报告附注

10.1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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

10.2基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	438,929.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	203,921.58
4	应收利息	1,646.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	644,497.38

10.4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。

10.5 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情况。

10.6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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 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。

自基金合同生效开始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	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
2013年12月5日至2013年12月31日	0.60%	0.03%	2.64%	0.62%	-2.04%	-0.59%
2014年1月1日至2014年12月31日	13.38%	0.67%	13.40%	0.69%	-0.02%	-0.02%
2015年1月1日至2015年6月30日	-2.72%	1.05%	-3.13%	1.06%	0.41%	-0.01%
2013年12月5日至2015年9月30日	12.11%	0.82%	14.08%	0.84%	-1.97%	-0.02%

第十五部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（一）、基金费用的种类

1、基金的管理费；

2、基金的托管费；

3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

4、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用；

5、基金的指数使用费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费，税务顾问费；

8、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）；

9、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；

10、基金的银行汇划费用；

11、与基金有关的诉讼、追索费用；

12、基金上市初费及年费；

13、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、基金的管理费

如果基金管理人为本基金聘请境外投资顾问，相关境外投资顾问费用应当从管理费中支取。

本基金的管理费按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.6%÷当年天数

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，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、基金的托管费

本基金托管费自基金合同生效日起，按如下方法进行计提。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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、指数许可使用费

本基金作为指数基金，需要根据与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数使用费。指数使用费自基金首次挂牌之日起累计，累计计提的指数使用费取以下a）、b）中孰高者：

a)按指数使用协议规定的费率每日计提金额的累计值；

每日计提金额的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

b）按指数使用协议规定的费用下限均摊到每日的累计值；

指数使用费每日计提，按季支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后，基金托管人于次季度首日起15日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

根据本条第（一）款"基金费用的种类"中包含的各项费用，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。

4、除管理费、托管费及指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

二、与基金销售有关的费用

投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照相应标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。最高不超过0.5%。

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，其纳税义务按各个国家税收法律、法规执行。

博时基金管理有限公司

2016年1月19日

（上接B104版）

（1）基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合本基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

（2）投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的投资比例、大类资产分布比例、组合基准久期、回购比例等重要事项。

（3）基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和个券投资分布方式等。

（4）对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

九、业绩比较基准

中债企业债总全价指数

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一、基金投资组合报告

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	989,470,467.80	95.92
	其中：债券	989,470,467.80	95.92
	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	19,811,240.33	1.92
7	其他资产	22,241,487.33	2.16
8	合计	1,031,523,195.46	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

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	192,078,137.40	20.27
	其中：政策性金融债	192,078,137.40	20.27
4	企业债券	526,323,330.40	55.53
5	企业短期融资券	271,069,000.00	28.60
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	989,470,467.80	104.40

5、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	018001	国开 1301	911,140	91,943,137.40	9.70
2	011557001	15中电 SCP001	500,000	50,380,000.00	5.32
3	011517001	15华电 SCP001	500,000	50,345,000.00	5.31
4	150211	15国开 11	500,000	50,155,000.00	5.29
5	071548001	15国开证券 CP001	500,000	50,040,000.00	5.28

6、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

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序的前五名贵金属投资明细

注：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序的前五名权证投资明细

注：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

注：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

基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

报告期内本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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有股票资产。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	26,678.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,766,977.17
5	应收申购款	1,447,831.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,241,487.33

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

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。

1、富国信用债债券型证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

（1）A级

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
2013.6.25-2013.12.31	-0.42%	0.13%	-3.86%	0.09%	3.44%	0.04%
2014.1.1-2014.12.31	11.69%	0.17%	5.92%	0.12%	5.77%	0.05%
2015.1.1-2015.9.30	7.08%	0.09%	1.13%	0.08%	5.95%	0.01%
2013.6.25-2015.9.30	19.10%	0.14%	2.98%	0.10%	16.12%	0.04%

（2）C级

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
2013.6.25-2013.12.31	-0.72%	0.12%	-3.86%	0.09%	3.14%	0.03%
2014.1.1-2014.12.31	11.31%	0.17%	5.92%	0.12%	5.39%	0.05%
2015.1.1-2015.9.30	6.82%	0.09%	1.13%	0.08%	5.69%	0.01%
2013.6.25-2015.9.30	18.04%	0.14%	2.98%	0.10%	15.06%	0.04%

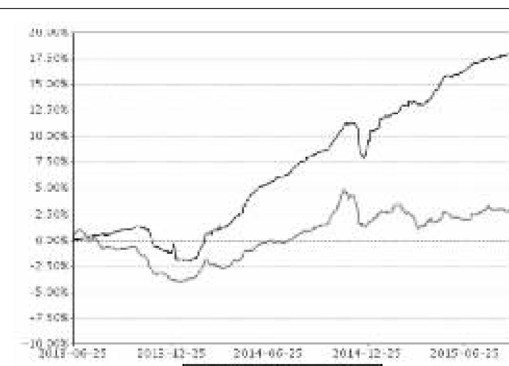
2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

（1）自基金合同生效以来富国信用债债券 A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1.截止日期为 2015 年 9 月 30 日。

2.本基金于 2013 年 6 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 6 月 25 日至 2013 年 12 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

（2）自基金合同生效以来富国信用债债券 A/B 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.截止日期为 2015 年 9 月 30 日。

2.本基金于 2013 年 6 月 25 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 6 月 25 日至 2013 年 12 月 24 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十三、费用概览

一、与基金运作有关的费用

(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、《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、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

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 0.7 %年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E× 0.7 %÷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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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、基金销售服务费

本基金 A 基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×基金销售服务费年费率÷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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。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。

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；

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。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费率

投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

（1）投资者在申购本基金 A 类基金份额时，需缴纳前端申购费。

本基金对通过直销中心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，本公司设定的养老金客户包括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等，具体包括：

1、全国社会保障基金；

2、可以投资基金的地方社会保障基金；

3、企业年金单一计划以及集合计划；

4、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；

5、企业年金养老金产品。

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，本公司将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。

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	0.24%
100万元(含)—500 万元	0.15%
500万元(含)以上	1000元/笔

其他投资者申购本基金 A 类基金份额申购费率见下表：

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	0.8%
100万元(含)—500 万元	0.5%
500万元(含)以上	1000元/笔

（2）投资者在申购本基金 B 类基金份额时，需缴纳后端申购费。

持有时间	后端申购费率
1年以内(含)	1%
1年-3 年(含)	0.6%
3年-5 年(含)	0.4%
5年以上	0

（3）C 类基金份额不收取申购费用。

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。

本基金 A 类和 B 类基金份额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、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）本基金的赎回费率

1）对于本基金 A 类和 B 类基金份额，赎回费率为：

持有年限	赎回费率
0—1 年(含)	0.1%
1年—2 年(含)	0.05%
2年以上	0

2）对于本基金 C 类基金份额，赎回费率为：

持有年限	赎回费率
0—29 天	0.1%
30天以上(含)	0

（2）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、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、转换费用

A 前端转前端

（1）基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

1）转出基金赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

2）转入基金申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式，转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费率为零。

（2）基金转换的计算：

转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率

转入金额＝转出金额－转出基金赎回费

净转入金额＝转入金额÷（1+申购补差费率）

申购补差费＝转入金额－净转入金额

转入份额＝净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后 2 位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

B 后端转后端

后端收费模式基金发生转换时，其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成，其中申购补差费率按照转入基金与转出基金的后端申购费率的差额计算。当转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时，基金转换申购费补差费率为转出基金与转入基金申购费率之差；当转出基金的后端申购费率低于转入基金的后端申购费率，申购补差费率为零。

（1）对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金，其后端收费模式下份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额 = 转出份额 × 转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

申购补差费用 =(转出金额 - 转出基金赎回费用) × 补差费率

净转入金额 = 转出金额 - 转出基金赎回费用 - 申购补差费用

转入份额 = 净转入金额 / 转换申请当日转入基金的基金份额净值

（2）对于由本公司担任注册登记机构的基金，后端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额 = 转出份额 × 转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用 = 转出金额 × 转出基金赎回费率

申购补差费 =（转出金额 - 转出基金赎回费用）× 补差费率 /（1+ 补差费率）

净转入金额 = 转出金额 - 转出基金赎回费用 - 申购补差费用

转入份额 = 净转入金额 / 转换申请当日转入基金的基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后 2 位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

三、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。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。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。

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》、《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》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、"重要提示"部分对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进行了更新。

2、"三、基金管理人"部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

3、对"四、基金托管人"部分进行了更新。

4、"五、相关服务机构"部分对代销机构部分信息进行了更新。

5、"八、基金份额的申购与赎回"部分对基金转换适用范围进行了更新。

6、"九、基金的投资"部分更新了基金投资组合报告，内容截止至 2015 年 9 月 30 日。

7、"十、基金的业绩"部分对基金业绩更新至 2015 年 9 月 30 日，并更新了历史走势对比图。

8、"二十二、其他应披露事项"部分对报告期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

富国基金管理有限公司

二〇一六年一月十九日

(上接B102版)

因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述约定的比例不在限制之内，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(八)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

七、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，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	权益投资	893,323,862.38	66.30
	其中：股票	893,323,862.38	66.30
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	442,783,564.26	32.86
8	其他资产	11,216,189.47	0.83
9	合计	1,347,323,616.11	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	419,136,330.99	31.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,427,664.58	0.71
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	34,340,177.69	2.58
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	234,341,131.16	17.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	73,084,371.63	5.48
M	科学研究和技术服务业	16,857,058.56	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	71,386,304.55	5.35
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	34,750,823.22	2.61
S	综合	-	-
	合计	893,323,862.38	67.01

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	300017	网宿科技	1,409,676	74,304,021.96	5.57
2	300299	富春通信	4,257,529	68,333,340.45	5.13
3	300207	欣旺达	2,494,680	62,317,106.40	4.67
4	002074	国轩高科	1,601,315	47,206,766.20	3.54
5	300058	蓝色光标	4,126,889	44,033,905.63	3.30
6	002573	清新环境	2,378,283	41,929,129.29	3.15
7	300145	南方泵业	1,158,900	40,016,817.00	3.00
8	000887	中鼎股份	2,175,529	38,093,512.79	2.86
9	300144	宋城演艺	1,539,009	34,750,823.22	2.61
10	600446	金证股份	1,266,195	32,161,353.00	2.41

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投资。

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投资。

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。

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

本基金未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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

本基金未投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

（2）基金投资的前十名股票未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	2,220,744.46
2	应收证券清算款	8,757,429.26
3	应收股利	-
4	应收利息	85,309.67
5	应收申购款	152,706.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,216,189.47

（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

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	300145	南方泵业	40,016,817.00	3.00	重大事项停牌
2	300058	蓝色光标	44,033,905.63	3.30	重大事项停牌
3	300299	富春通信	68,333,340.45	5.13	重大事项停牌
4	000887	中鼎股份	38,093,512.79	2.86	重大事项停牌
5	600446	金证股份	32,161,353.00	2.41	重大事项停牌

八、基金的业绩

基金业绩截止日为2015年9月30日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。

1、 净值增长率与同期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
2010/12/07-2010/12/31	-0.47%	0.41%	-0.07%	1.40%	-0.40%	-0.99%
2011/01/01-2011/12/31	-23.67%	1.17%	-26.46%	1.15%	2.79%	0.02%
2012/01/01-2012/12/31	20.09%	1.43%	0.27%	1.11%	19.82%	0.32%
2013/01/01-2013/12/31	60.43%	1.68%	18.99%	1.16%	41.44%	0.52%
2014/01/01-2014/12/31	11.77%	1.38%	23.25%	0.91%	-11.48%	0.47%
2015/01/01-2015/09/30	24.16%	2.92%	12.63%	2.32%	11.53%	0.60%
2010/12/07-2015/09/30	103.11%	1.74%	21.71%	1.36%	81.40%	0.38%

2、基金累计份额净值增长率与比较基准收益率走势对比

华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010年12月7日至2015年9月30日）

注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2011年6月6日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

九、基金份额的申购和赎回

（一）基金份额申购和赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体销售网点将由基金管理人在份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体办法另行公告。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2011年1月26日起开始办理日常申购、赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，视同下次开放时间提交的申请。

（三）申购与赎回的原则

1、"未知价"原则，即基金的申购与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、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、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在该销售机构的基金份额进行处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金的申购和赎回以书面或经基金管理人认可的其他方式进行；

6、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，但最迟应在新的原则实施前三个工作日予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资人须按基金管理人和销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，在其提出赎回申请的销售机构（网点）交易账号内必须有足够的基金份额余额。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，投资人交付申购款项，申购成立。登记机构确认基金份额的，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。申购不成立或无效，申购款项将退回投资人账户。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立。登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，赎回款项在自成交确认日起五个工作日内划往投资人银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

通过代销网点和直销e网金申购本基金单笔最低金额为100元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为100元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

代销网点的投资人欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、申请赎回基金的份额

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于100份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足100份的，在赎回时需一次全部赎回。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的规定，但最迟应在调整生效前三个工作日在至少一种指定媒介予以公告。

（六）基金的申购费和赎回费

1、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。本基金的申购费率表如下：

申购金额	申购费率
500万(含)以上	每笔1000元
大于等于200万，小于500万	0.5%
大于等于100万，小于200万	1.0%
大于等于50万，小于100万	1.2%
50万以下	1.5%

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有基金份额期限	赎回费率(%)
小于7日	1.50%
大于等于7日，小于30日	0.75%
大于等于30日，小于1年	0.50%
大于等于1年，小于2年	0.25%
大于等于2年	0

本基金的赎回费用由赎回人承担，其中25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付登记费等相关手续费。

十、基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、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）基金的证券交易费用；

（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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

2、费率水平、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五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（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五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）本条第1款第（3）至第（7）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。

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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金管理人和基金托管人可协商酌情调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会，但应报经中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒介上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"八、基金份额的申购与赎回"中的"（六）基金的申购费和赎回费"中的相关规定。本基金与公司管理的其它基金间的转换费率、计算公式、转换程序请详见本招募说明书"九、与基金管理人管理的其他基金转换"中的相关规定。

十一、《招募说明书》更新部分的说明

根据《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》)及其他有关规定，华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业新兴产业混合型证券投资基金招募说明书》作如下更新：

1、根据《华宝兴业基金管理有限公司关于修改华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金基金名称及基金合同的公告》更新了本基金名称，并根据法律法规更新了相关内容。

2、"三、基金管理人"更新了基金管理人的相关情况。

3、"四、基金托管人"更新了基金托管人的相关情况。

4、"五、相关服务机构"更新了代销机构的相关信息。

5、"九、与基金管理人管理的其他基金转换"更新了办理转换业务的销售机构和本基金与其他基金转换的相关内容。

6、"十、基金的投资"更新了截至2015年9月30日的基金投资组合报告。

7、"十一、基金的业绩"更新了截至2015年9月30日的基金业绩数据。

8、"二十三、其他应披露事项"对本报告期内的相关公告作了信息披露。

上述内容仅为摘要，须与本基金《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司

2016年1月19日