(上接B25版)

77	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 法定代表人:杨懿 联系人:张燕 电话:010-83363099 传真:010-83363072 客服电话:400-166-1188 网址:https://8.jrj.com.cn
78	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人:梁越 联系人:马鹏程 电话:010-56810780 传真:010-57756199 客服电话:400-786-8868-5 网址:www.chtfund.com
79	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 办公地址: 北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 法定代表人: 梁蓉 联系人: 张旭 电话:010-66154828 传真:010-88067526 客服电话:400-6262-818 网址:www.5irich.com
80	海银基金销售有限公司	注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元 办公地址:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场16楼 法定代表人:刘惠 联系人:刘艳妮 电话:021- 80133827 传真:021-80133413 客服电话:400-808-1016 网址:www.fundhaiyin.com
81	上海联泰资产管理有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼 法定代表人:燕斌 联系人:汤蕾 电话:021-51507071 传真:021-62990063 客服电话:4000-466-788 网址:http://www.66money.com
82	北京增财基金销售有限公司	注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208 法定代表人:罗细安 联系人:史丽丽 电话:010-67000988-6028 传真:010-67000988-6000 客服电话:010-67000988 网址:www.zcvc.com.cn
83	上海汇付金融服务有限公司	注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 办公地址:上海市黄浦区中山南路100号19层 法定代表人: 冯修敏 联系人: 周丹 电话:021-33323999 传真:021-33323993 客服电话:400-820-2819 网址:https://tty.chinapnr.com
84	中信建投期货有限公司	注册地址: 重庆 办公地址: 渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B、C 法定代表人: 彭文德 联系人:万恋 电话:021-68762007 传真:021-68763048 客服电话:400-8877-780 网址:www.cfc108.com
85	上海陆金所资产管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 法定代表人: 郭坚 联系人: 宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
86	中信期货有限公司	注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 法定代表人: 张皓 联系人: 洪诚 电话:0755-23953913 传真:0755-83217421 客服电话:400-990-8826 网址:http://www.citicsf.com
87	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔B1201-1203室 法定代表人:肖雯 联系人:吴煜浩 电话:020-89629099 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
88	深圳富济财富管理有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室 法定代表人:齐小贺 联系人:陈勇军 电话:0755-83999907-806 传真:0755-83999926 客服电话:0755-83999913 网址:www.jinqianwo.cn
89	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 法定代表人: 陈继武 联系人: 李晓明 电话:021-6333319 传真:021-63332523 客服电话:4000178000 网址:www.lingxianfund.com
90	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.1.2场内销售机构

场内销售机构是指具有基金代销业务资格、并经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关证券交易所会员单位,具体名单以交易所网站刊载内容为准。

3.2登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
联系人:崔巍
电话:010-50938856
传真:010-59378907

3.3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
负责人:俞卫锋
联系人:黎明
电话: (86 21) 3135 8666
传真: (86 21) 3135 8600
经办律师:黎明、孙睿

3.4审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:陈熹
经办注册会计师:薛竞、陈熹

§4基金名称

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金

§5基金的类型

股票型证券投资基金

§6基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的回报。

§7基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

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。

基金的投资组合比例为:

本基金80%以上的基金资产投资于股票。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

§8基金的投资策略

8.1投资策略

本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因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。

(一)资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法,按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下,本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)股票投资策略

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。

1、股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。特殊情况下,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

2、股票投资组合的调整

(1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

(2)不定期调整

1) 当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整;

2) 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

3) 特殊情况下,如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊情况包括但不限于以下情形:①法律法规的限制;②标的指数成份股长期停牌;③标的指数成份股流动性严重不足;④成份股上市公司存在重大违规行为,有可能面临重大的处罚或诉讼。

(三)债券投资策略

在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中,采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式,获取超额的投资收益。

(四)权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(五)股指期货等投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

8.2投资决策依据和决策程序

1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。基金管理人有权根据基金运作情况选择、更换或撤销境外投资顾问,为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究支持:指数化投资研究小组依托基金管理人整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、成份股公司行为、股指期货跟踪有效性等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告,定期或遇重大事项时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理以复制标的指数成份股的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,降低买入成本,控制投资风险。

(4)交易执行:中央交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估:指数化投资团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此调整投资组合。

(6)组合维护:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,紧密跟踪标的指数。

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体制和程序做出调整,并在更新的《招募说明书》中列示。

§9基金业绩比较基准

本基金的标的指数:中证高铁产业指数及其未来可能发生的变更。

本基金的业绩比较基准:标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。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),且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,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,报中国证监会备案并及时公告。

§10基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看,高铁A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征;高铁B份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

§11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。

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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日(未经审计)。

1.1 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	188,419,851.83	91.56
	其中:股票	188,419,851.83	91.56
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	16,216,710.94	7.88
7	其他资产	1,145,388.03	0.56
8	合计	205,781,950.80	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	99,765,693.99	48.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	85,408,757.84	41.81
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	3,245,400.00	1.59
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	188,419,851.83	92.24

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

1.3 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

1.3.1 报告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

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	601186	中国铁建	2,307,896	31,271,990.80	15.31
2	601390	中国中铁	2,145,917	23,476,331.98	11.49
3	601766	中国中车	1,785,828	23,162,189.16	11.34
4	600820	隧道股份	1,051,293	12,173,972.94	5.96
5	601800	中国交建	1,021,276	12,122,546.12	5.93
6	600528	中铁二局	532,100	6,363,916.00	3.12
7	000825	太钢不锈	1,523,838	6,125,828.76	3.00
8	600169	太原重工	1,134,701	5,809,669.12	2.84
9	600495	晋西车轴	565,600	5,288,360.00	2.59
10	300001	特锐德	294,840	4,985,744.40	2.44

1.3.2 报告期末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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.5 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

1.11.2

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。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	648,344.34
2	应收证券清算款	377,584.48
3	应收股利	-
4	应收利息	3,676.18
5	应收申购款	115,783.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,145,388.03

1.11.4 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。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1 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

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	600528	中铁二局	6,363,916.00	3.12	重大事项停牌

1.11.5.2 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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§12基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、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)
2015.6.10-2015.9.30	-35.08%	4.33%	-45.22%	4.26%	10.14%	0.07%
自基金成立起至今	-35.08%	4.33%	-45.22%	4.26%	10.14%	0.07%

§13基金的费用概览

13.1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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费;
4、基金上市费用及年费;
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券/期货交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、基金相关账户的开户及维护费用;
11、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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷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、公休日等,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0.2%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、基金合同生效后标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人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使用许可费计提方法支付指数使用许可费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年指数使用费率÷当年天数,本基金年指数使用费率为0.02%

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

基金合同生效后的指数许可使用费每日计算,逐日累计,按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币50,000元,计费区间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后于每一季度末结束后的10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述"一、基金费用的种类中第4-11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、费用调整

基金管理人可以根据与基金份额持有人利益一致的原则,结合产品特点和投资人的需求设置基金管理费率的结构和水平。

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,酌情调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。除根据法律法规要求提高该等报酬标准以外,提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、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。

13.2与基金销售有关的费用

申购费用和赎回费用

1、?本基金场外申购费率最高不高于0.6%,且随申购金额的增加而递减,如下表所示:

申购金额(M)	申购费率
M<100万	0.6%
M≥100万	每笔500元

本基金基础份额的场内申购费率为0。

投资人重复申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

申购费用由投资人承担,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。

2、本基金场外赎回费率不高于0.5%,随申请份额持有时间增加而递减(其中1年为365天)。具体如下表所示:

申请份额持有时间(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

本基金场内赎回费率为0.5%。

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,南方高铁份额的赎回费用在基金份额持有人赎回基金份额时收取,不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下,对基金销售费用实行一定的优惠,费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

§14对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金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,对本基金的原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,对"重要提示"进行了更新。
2、在"基金管理人"部分,对"主要人员情况"进行了更新。
3、在"相关服务机构"部分,对"销售机构"进行了更新,对"审计基金财产的会计师事务所"进行了更新。
4、在"基金的募集"部分,对"基金的募集"进行了更新。
5、在"基金合同的生效"部分,对"基金合同的生效"进行了更新。
6、在"基金份额的上市交易"部分,对"基金份额的上市交易"进行了更新。
7、在"基金份额的申购和赎回"部分,对"申购与赎回的开放日及时间"进行了更新,对"申购与赎回的数额限制"进行了更新,对"申购费用和赎回费用"进行了更新,对"申购份额与赎回金额的计算"进行了更新,对"定投计划"进行了更新。
8、在"场内份额配对转换"部分,对"场内份额配对转换"进行了更新。
9、在"基金的投资"部分,对"基金投资组合报告"进行了更新,对"基金业绩"进行了更新。
10、在"基金份额持有人服务"部分,对"基金份额持有人服务"进行了更新。
11、在"其他应披露事项"部分,对"其他应披露事项"进行了更新。
12、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
2016年1月20日

(上接B26版)

2、权益类资产投资策略

(1)新股申购策略

本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面因素,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,从而制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票,将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低,确定继续持有或者卖出。

(2)二级市场股票投资策略

①行业配置策略

基金管理人对宏观经济形势与政策、行业景气程度、上市公司代表性等方面进行研究,以此为基础,以投资业绩比较基准中各个行业的权重为参照,进行行业配置决策。

各行业之间的预期收益、风险及其相关性仍然是制定行业配置决策时的根本因素,因而基金管理人的研究将围绕着对它们产生重大影响的因素或指标展开,主要包括各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服务的供需情况、上市公司代表性、行业整体相对估值水平等。通过对上述因素或指标的综合评估,基金管理人定期确定各行业的配置水平。

②个股投资策略

本基金在大类资产配置和行业配置下,通过对股票基本面的分析来精选个股。本基金的分析框架主要包括股票的价值性指标和成长性指标。价值性投资的核心思想是寻找市场上价值被低估的上市公司,具体指标包括:市盈率、市净率、市销率、股息收益率等。成长性投资的核心思想是寻找市场上未来能够高速成长的上市公司,具体指标包括:预期净利润增长率、中长期净利润增长率、内部成长率及历史增长率等。

表1 本基金参考的价值性指标与成长性指标

价值性指标	成长性指标
市盈率	预期净利润增长率
市净率	中长期净利润增长率
市销率	内部成长率
股息收益率	历史增长率

具体来说,本基金遵循如下投资步骤:

I、对股票的风格特征进行评估,从股票池中选择成长与价值特性突出的股票。

II、应用基本面分析方法,确定优质成长股与优质价值股的评价标准,在第一步选择出的具有鲜明风格的股票名单中,进一步分析,选出基本面较好的股票。

III、根据市场环境确定成长股与价值股在股票资产中的配置比例,动态调整,以控制因风格带来的投资风险,降低组合波动,提高整体收益率。

(3)权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

(三)投资决策体制和流程

1、投资决策体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构,根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度,确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则;确定基金的总体投资方案;负责基金资产的风险控制,审批重大投资事项;监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策,构建投资组合、并负责组织实施、追踪和调整,以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议,并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令,进行基金资产的日常交易,对交易情况及时反馈。

2、投资流程

(1)研究分析

基金管理人的研究和投资部门广泛地参考和利用外部的研究成果,了解国家宏观货币和财政政策,对资金利率走势及债券发行人的信用风险进行监测,并建立相关研究模型。基金管理人的研究部门撰写宏观策略报告、利率监测报告、债券发行人资信研究报告以及拟投资上市公司投资价值分析报告等,作为投资决策的重要依据。

基金管理人的研究和投资部门定期或不定期举行投资研究联席会议,讨论宏观经济环境、利率走势、债券发行人信用级别变化以及拟投资上市公司情况等相关问题,作为投资决策的依据。

(2)投资决策

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规以及公司有关规章制度确定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围,审批总体投资方案以及重大投资事项。

基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、投资结构、持仓比例范围等总体投资方案,并结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断、以及基金申购赎回情况和市场整体情况,构建并优化投资组合。对于超出权限范围的投资,按照公司权限审批流程,提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

(3)交易执行

交易部接受基金经理下达的交易指令。交易部接到指令后,首先应对指令予以审核,然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的,交易部可以暂不执行指令,并即时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议,以便基金经理及时调整交易策略。

(4)投资回顾

绩效评估小组定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况,并提出下期的操作思路,作为投资决策委员会决策的参考。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:60%×天相可转债指数收益率+30%×中国债券总指数收益率+10%×沪深300指数收益率。

天相可转债指数是以沪深两市所有可转债的交易价格,按发行公司公告的实际未转股规模帕氏加权计算,反映两市可转债的总体走势。天相可转债指数的基期为1999年12月30日,是国内较早编制的可转债指数。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征,也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势,测算债券投资回报率水平,判断债券供求动向提供了很好的依据。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念,本基金选择了该组合作为本基金的业绩比较基准。该业绩比较基准能够较好地反映本基金的风险收益特征。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示,报中国证监会备案并公告。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低风险收益的品种。

本基金主要投资于可转债,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日,本报告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	28,065,952.57	9.15
	其中:股票	28,065,952.57	9.15
2	固定收益投资	271,533,317.30	88.54
	其中:债券	271,533,317.30	88.54
	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	5,875,944.48	1.92
7	其他各项资产	1,188,710.32	0.39
8	合计	306,663,924.67	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(%)
	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,887,052.57	4.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,756,300.00	1.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,424,200.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	7,770,400.00	2.65
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	-	-
	房地产业	1,228,000.00	0.42
	租赁和商务服务业	-	-
	科学研究和技术服务业	-	-
	水利、环境和公共设施管理业	-	-
	居民服务、修理和其他服务业	-	-
	教育	-	-
	卫生和社会工作	-	-
	文化、体育和娱乐业	-	-
	综合	-	-
	合计	28,065,952.57	9.56

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

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	601006	大秦铁路	880,000	7,770,400.00	2.65
2	600585	海螺水泥	300,000	5,055,000.00	1.72
3	000600	建投能源	320,000	2,748,800.00	0.94
4	600755	厦门国贸	340,000	2,424,200.00	0.83
5	000860	顺鑫农业	140,000	2,200,800.00	0.75
6	000060	中金岭南	199,963	1,877,652.57	0.64
7	600500	中化国际	160,000	1,640,000.00	0.56
8	600185	格力地产	80,000	1,228,000.00	0.42
9	000999	华润三九	50,000	1,165,000.00	0.40
10	600795	国电电力	250,000	1,007,500.00	0.34

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	12,749,104.80	4.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,891,000.00	10.52
	其中:政策性金融债	30,891,000.00	10.52
4	企业债券	227,893,212.50	77.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	271,533,317.30	92.49

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	126018	08江铜债	2,300,750	226,416,807.50	77.12
2	140440	14农发40	300,000	30,891,000.00	10.52
3	020078	15贴债04	30,000	2,949,000.00	1.00
4	019509	15国债09	29,000	2,905,800.00	0.99
5	020076	15贴债02	28,000	2,743,720.00	0.93

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和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	398,328.21
2	应收证券清算款	206,139.64
3	应收股利	-
4	应收利息	584,242.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,188,710.32

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未存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截至日为2015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12月31日	97.24%	1.38%	41.11%	0.73%	56.13%	0.65%
2015年1月1日-2015年9月30日	23.15%	1.42%	-16.50%	2.31%	39.65%	-0.89%
2012年5月29日-2015年9月30日	146.80%	1.12%	15.58%	1.20%	131.22%	-0.08%

(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12月31日	96.63%	1.38%	41.11%	0.73%	55.52%	0.65%
2015年1月1日-2015年9月30日	22.71%	1.42%	-16.50%	2.31%	39.21%	-0.89%
2012年5月29日-2015年9月30日	143.70%	1.12%	15.58%	1.20%	128.12%	-0.08%

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
二〇一六年一月二十日