(上接B81版)

本基金采用积极主动的投资策略。以宏观经济和政策研究为基础,通过影响证券市场整体运行的内外部因素分析,实施大类资产配置;分析以内需增长为重要推动力的中国经济转型进程中的政策导向与经济结构调整的特点,研究国内消费需求以及与之紧密关联的投资需求的增长规律,结合经济周期与产业变迁路径的分析,实施行业配置;以相关的投资主题和内需增长受益行业为线索,通过公司基本面的考量,精选优质上市公司股票,力求实现基金资产的长期稳健增值。

为有效控制投资风险,本基金将根据风险管理的原则适度进行股指期货投资,股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。

1. 大类资产配置

本基金以股票投资为主,但为规避市场系统性风险,保障基金资产的长期稳健增值,本基金实施适度的战略或战术性类别资产配置。本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别,对股票、债券及现金等大类资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。在大类资产调整过程中,本基金将在法律法规和基金合同规定范围内,适度运用股指期货的套期保值功能,控制投资组合的系统性风险暴露。

本基金采用多因素分析框架,从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场运行内在动量等方面,采取定量与定性相结合的分析方法,对证券市场投资机会与风险进行综合研判。宏观经济环境方面,主要是对证券市场基本面产生普遍影响的宏观经济环境进行分析,研判宏观经济运行趋势以及对证券市场的影响。政策因素方面,主要是对影响经济结构、金融和证券市场的政策进行前瞻性分析,研究政策对不同类别资产的影响。市场利率水平方面,主要分析市场利率水平的变化趋势及对固定收益证券的影响。资金供求因素方面,主要分析证券市场供求的平衡关系。投资价值方面,主要研究各类证券市场的整体内在价值的变化和估值水平的相对变化。市场运行内在动量方面,主要分析证券市场自身的内在运行惯性与回归(规律),发现驱动证券市场向上或向下的市场因素。

通过上述因素的综合分析,结合公司研究开发的定量模型工具,判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例。

此外,本基金还将利用基金管理人在长期投资管理过程中所积累的经验、根据市场突发事件、市场非有效例外效应等所形成的市场波动做战术性资产配置调整。

2. 股票投资策略

本基金的股票投资决策是:采取自上而下为主、自下而上为辅的积极管理策略,深入分析作为中国经济转型重要推动力的内需增长的外部环境条件、政策导向、实现路径与操动作用,发掘与之相关的投资主题,结合行业受益敏感性与投资主题进行行业选择;运用细致的公司基本面分析,结合估值模型,挖掘重点行业中的优质上市公司股票。

(1)行业配置策略

本基金主要投资于受益于内需增长的行业,以分享国内经济增长以及经济结构转型所带来的行业利润的增长。

受益于内需增长的行业主要包括以下两类:

一类是受益于国内消费需求增长的行业,即为消费水平提升中的国内消费者提供消费品和消费服务的行业,根据申银万国行业分类标准,主要包括食品饮料、商业贸易、医药生物、纺织服装、金融服务、房地产、餐饮旅游、家用电器、信息服务等行业。

另一类是受益于国内城市化建设和国内消费增长驱动的投资需求的行业,即为国内城市化建设、消费增长所需投资提供原材料、设备、建造服务和物流服务的行业,根据申银万国行业分类标准,主要包括化工、黑色金属、有色金属、建筑建材、电子元器件、信息设备、交运设备、交通运输等行业。

本基金基于行业研究小组的研究成果,通过分析宏观经济环境、国家财政政策和货币政策、区域及产业发展规划、城市化进程、基础设施建设、居民消费升级、消费文化、社会保障体系建设等内需影响因素,研究内需增长的区域特征、梯度演进、实现路径以及在内需增长、技术变迁推动下的行业发展特点,评估各个内需增长受益行业对内需增长的盈利敏感程度,并结合证券市场的投资主题和经济周期中的行业景气轮动特点,比较不同行业的相对投资价值,确定行业配置方案。

本基金将80%以上的股票资产投资于受益于内需增长的行业中的优质企业。

(2)股票组合构建策略

本基金将剔除最近一期年报中有明确数据显示其主营业务收入60%以上来源于海外的上市公司(除非有充分的研究成果表明其主营业务收入来源正在发生由境外到境内的根本性转变),并在行业配置策略的基础上,深入研究公司基本面,精选受益于内需增长的上市公司,并结合风险管理,对股票组合构建进行动态调整。

公司基本面研究主要包括公司在内需增长背景下的成长性评估和投资价值评估。成长性评估将首先研究基于内需增长背景下产业政策、消费趋势、供应商力量、行业壁垒、商业模式与技术变迁等因素对行业竞争格局演变的影响,然后分析公司战略、资源与能力等方面的优势,评判公司的行业竞争地位以及业绩驱动因素,最后运用主营业务收入、EBITDA、净利润等的预期增长率指标,结合公司营运指标(如固定资产周转率等)以及经营杠杆指标(如权益乘数等),对公司盈利的持续增长前景进行综合评价。投资价值评估是根据一系列历史和预期的财务指标,结合定性考虑,分析公司盈利稳固性,判断相对投资价值,主要指标包括:EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率、ROE、经营利润率和净利润率等。分析师将根据行业特点选择合适的指标进行估值。

根据公司基本面考量结果,本基金将精选受益于内需增长而具有较好的盈利增长前景且估值合理的上市公司,结合行业配置策略,构建股票组合。

在股票组合构建与调整过程中,本基金将运用风险绩效评估及归因分析方法,控制组合风险。

3. 债券投资策略

主要通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等策略配置债券资产,力求在保证资产总体的安全性、流动性的基础上获取稳定收益。

1)利率预测分析

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时,适当加大组合中长久期债券的投资比例,为债券组合获取价差收益;当预期利率上升时,减少长久期债券的投资,降低债券组合的久期,以控制利率风险。

2)收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。通过预测收益率曲线形状的变化,调整债券组合内部品种的比例,获得投资收益。

3)债券信用分析

通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研,准确评价债券的违约概率,提早预测债券评级的改变,捕捉价格优势或套利机会。

4)收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上,采取积极投资策略,选择适当品种,获取投资收益。

4. 权证投资

在控制投资风险和保障基金资产安全的前提下,对权证进行投资,争取获得较高的回报。权证投资策略主要为:采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价,作为权证投资的价值基准,并根据权证标的股票基本面的研究估值,结合权证理论价值进行权证趋势投资。

5. 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能,改变投资组合的Beta,以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此,套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求,需要在未来买入现货股票,为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作;空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险,控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成,决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中,基金管理人通过对股票组合的结构分析,分离组合的系统性风险(beta)及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合beta值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰,通过大量数据分析与量化建模,确立最优套保比率。

在套期保值过程中,基金管理人将不断精细和不断修正套保策略、动态管理套期保值组合。主要工作包括,基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理;对投资组合beta系数的实时监控,全程评估套期保值的效果和基差风险,当组合beta值超过事先设定的beta容忍度时,需要对套期保值组合进行及时调整;进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数

本基金作为股票基金,股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%,固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-40%,所以采用股票指数和债券指数加权复合的方法构建业绩比较基准。由于沪深300指数是反映沪深两市A股综合表现的跨市场成份指数、中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,两者均具有良好的市场代表性,因此,选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准,同时,选取中证综合债券指数作为债券投资部分的比较基准。参考股票投资比例上下限的均值,确定股票指数加权比例为80%;参考债券投资比例上下限的均值,确定债券指数加权比例为20%。

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基准的股票指数时,本基金可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

十二、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年12月23日复核了本基金投资组合报告中的财务指标、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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	362,287,501.19	67.07
	其中:股票	362,287,501.19	67.07
2	基金投资	-	0.00
	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
3	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
	买入返售金融资产	-	0.00
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	177,286,795.28	32.82
8	其他资产	602,178.26	0.11
9	合计	540,176,474.73	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	240,145,460.54	46.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,299,472.60	1.79
H	住宿和餐饮业	4,896,000.00	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	71,734,226.78	13.81
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	9,808,728.27	1.89
M	科学研究和技术服务业	18,095,616.00	3.48
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,307,997.00	1.60
S	综合	-	0.00
	合计	362,287,501.19	69.74

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	002517	泰亚股份	1,198,469	49,964,172.61	9.62
2	300017	网宿科技	484,638	25,545,268.98	4.92
3	300284	苏交科	831,600	18,095,616.00	3.48
4	300136	信维通信	637,580	17,705,596.60	3.41
5	002271	东方雨虹	999,946	17,649,046.90	3.40
6	002594	比亚迪	286,478	17,191,544.78	3.31
7	300207	欣旺达	644,702	16,104,655.96	3.10
8	002174	游族网络	245,774	14,653,045.88	2.82
9	002354	天神娱乐	186,906	14,027,295.30	2.70
10	000063	中兴通讯	881,152	13,745,971.20	2.65

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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明细

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

本基金本报告期末无股指期货持仓。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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未出现本期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。

(2)本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	429,568.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,201.37
5	应收申购款	141,407.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	602,178.26

(4)报告期末基金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	002174	游族网络	14,653,045.88	2.82	重大事项

(6)由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

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。

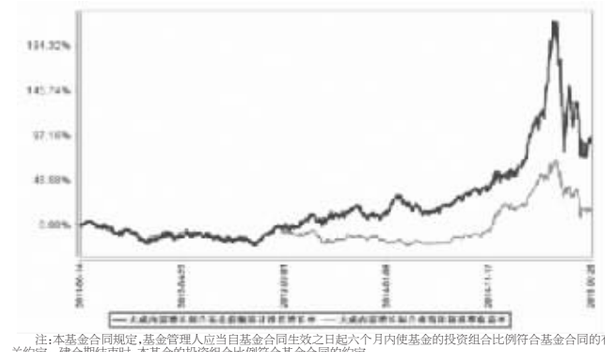
(一)自基金合同生效日(2011年6月14日)至2015年9月30日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及与同期业绩比较基准收益率的比较:

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
2011.06.14-2011.12.31	-17.30%	1.01%	-15.95%	1.08%	-1.35%	-0.07%
2012.01.01-2012.12.31	8.10%	1.17%	7.09%	1.02%	1.01%	0.15%
2013.01.01-2013.12.31	25.73%	1.49%	-5.90%	1.12%	31.63%	0.37%
2014.01.01-2014.12.31	36.03%	1.30%	42.57%	0.97%	-6.54%	0.33%
2015.01.01-2015.09.30	27.27%	3.02%	-5.55%	2.16%	32.82%	0.86%
2011.06.14-2015.09.30	94.60%	1.71%	14.06%	1.31%	80.54%	0.40%

(二)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:

大成内需增长混合型证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年6月14日至2015年9月30日)



注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

十四、费用概览

(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、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、律师费和诉讼费;

7、基金资产的资金汇划费用及证券账户等的开户费用;

8、H类份额需要承担因申购赎回产生的资金跨境划拨费用;

9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生的费用,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

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2个工作日内从基金资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为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第(一)款第3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。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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资产的损失;

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。

(四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(五)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。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《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2015年7月29日公布的《大成内需增长混合型证券投资基金更新招募说明书(2015年1期)》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. 根据最新资料,更新了"三、基金管理人"部分。
2. 根据最新资料,更新了"四、基金托管人"部分。
3. 根据最新资料,更新了"五、相关服务机构"部分。
4. 根据最新数据,更新了"八、基金的投资部分,(十)基金投资组合报告"。
5. 根据最新数据,更新了"九、基金的业绩"部分。
6. 根据最新公告,更新"二十二、其他应披露的事项"。
7. 根据最新情况,更新了"二十三、对招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司
二〇一六年一月二十九日

(上接B83版)

1)富国工业4.0份额

富国工业4.0份额标有人新增的富国工业4.0份额=

$$\frac{NUM_{B_{新}}^{基} \times (NAV_{B_{新}}^{基} - 1.000)}{1.000}$$

标注为列"富国工业4.0"份额的基金份额标有人按照TA登记方式或场内撤单,并富山二业4.0份额申购时,对在场内富山工业4.0份额基金份额对应的份额计算后,进行转换为富山二业4.0份额份额。

2)富山工业1.0A份额

扣减富山工业1.0A份额的基金份额参考净值低于对小数,即 $NUM_A^{基} = NUM_A^{基}$

富山工业1.0A份额扣减人新增份额后的富山工业1.0份额份额=

$$\frac{NUM_A^{基} \times (NAV_A^{基} - 1.000)}{1.000}$$

其中,

NU: 计算富山工业1.0A份额份额,不同

3)富山工业4.0B份额

折算后富山工业4.0B份额的份额数,即 $NUM_B^{基} = NU$

富山工业4.0B份额参与人新增份额后的富山工业4.0份额份额=

$$\frac{NUM_B^{基} \times (NAV_B^{基} - 1.000)}{1.000}$$

其中,

NU: 折算后富山工业4.0B份额的份额数,不同

NU: 折算后富山工业4.0B份额的份额数,不同

NU: 折算后富山工业4.0B份额的份额数,不同

4)折算后富山工业4.0份额的总份额数

折算后富山工业4.0份额的总份额数=折算前富山工业4.0份额的份额数+富山工业4.0份额持有人新增的富山工业4.0份额数+富山工业4.0A份额持有人新增的场内富山工业4.0份额数+富山工业4.0B份额持有人新增的场内富山工业4.0份额数

5)按照上述折算和计算方法,可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差,视为未改变基金份额持有人的资产净值。

2、当富山工业4.0B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下,本基金将按以下规则进行不定期份额折算:

(1)基金份额不定期折算基准日

富山工业4.0B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下,基金管理人将确定不定期折算基准日。

(2)基金份额折算对象

基金份额不定期折算基准日登记在册的富山工业4.0A份额、富山工业4.0B份额、富山工业4.0份额。

(3)基金份额折算频率

不定期。

(4)基金份额折算方式

当富山工业4.0B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下,本基金将分别对富山工业4.0A份额、富山工业4.0B份额和富山工业4.0份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保富山工业4.0A份额和富山工业4.0B份额的比例为1:1,份额折算后富山工业4.0份额的基金份额净值、富山工业4.0A份额和富山工业4.0B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。富山工业4.0份额、富山工业4.0A份额和富山工业4.0B份额的份额数将相应缩减。

1)富山工业4.0B份额

$$NUM_B^{基} = \frac{NUM_B^{基} \times NAV_B^{基}}{1.000}$$

2)富山工业1.0A份额

扣减富山工业1.0A份额的富山工业4.0B份额份额支撑对小数,即 $NUM_A^{基} = NU$

富山工业4.0A份额扣减人新增份额后的富山工业4.0份额份额=

$$\frac{NUM_A^{基} \times NAV_A^{基} - NUM_A^{基} \times 1.000}{1.000}$$

3)富山工业1.0份额

$$NUM_{基金} = \frac{NUM_{基金} \times NAV_{基金}}{1.000}$$

NU: 富山工业4.0份额份额,人新增份额后的富山工业4.0份额份额数,不同

4)折算后富山工业4.0份额的总份额数

折算后富山工业4.0份额的总份额数=富山工业4.0份额持有人持有的折算后的富山工业4.0份额的份额数+富山工业4.0A份额持有人新增的场内富山工业4.0份额数

5)按照上述折算和计算方法,可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差,视为未改变基金份额持有人的资产净值。

(三)折算份额数的处理方式

折算后,场外份额的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产;场内份额的份额数取整计算(最小单位为1份),余额计入基金资产。

(四)基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停相关份额的上市交易和富国工业4.0份额的申购或赎回等相关业务,具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(五)基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒介公告,并报中国证监会备案。

(六)特殊情形的处理

1、基金合同生效不满三个月,基金管理人可以不进行定期份额折算;

2、若在定期份额折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时,基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则,根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

(七)其他事项

基金管理人、深圳证券交易所、基金登记机构有权调整上述规则,本基金基金合同将相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会,并在本基金更新的招募说明书中列示。

十七、 对招募说明书更新部分的说明

富国中证工业4.0指数分级证券投资基金招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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,主要更新内容如下:

1、在"重要提示"部分,增加了基金合同生效日、招募说明书内容的截止日期及相关财务数据的截止日期。

2、在"第三部分基金管理人"中,对基金管理人概况及主要人员情况进行了更新。

3、在"第四部分基金托管人"中,对基金托管人的基本情况及基金托管业务经营情况进行了更新。

4、在"第五部分相关服务机构"中,对代销机构部分信息进行了更新。

5、在"第七部分基金的募集"部分,删除了募集期、发售对象、发售方式等已不适用信息,增加了本基金募集情况;

6、"第八部分基金合同的生效"部分增加了基金合同生效日。

7、"第十部分基金份额的申购与赎回"部分,增加了本基金开放申购、赎回的日期以及转换的内容。

8、"第十三部分基金的投资"部分,增加了基金投资组合报告,内容截止至2015年9月30日。

9、增加了"第十四部份基金的业绩",内容截止至2015年9月30日。

10、增加了"第二十七部分其他应披露事项",对本报告期内的其他事项进行披露。

富国基金管理有限公司
2016年1月29日

富国中证红利指数增强型证券投资基金二〇一五年年度收益分配公告

2016年1月29日

1 公告基本信息

基金名称	富国中证红利指数增强型证券投资基金	
基金简称	富国中证指数增强	
基金主代码	100032	
基金合同生效日	2008年11月20日	
基金管理人名称	富国基金管理有限公司	
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司	
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《富国中证红利指数增强型证券投资基金基金合同》、《富国中证红利指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新等	
收益分配基准日	2015年12月31日	
截止收益分配基准日的相关指标	基准日基金份额净值 (单位:人民币元)	1.826
	基准日基金可供分配利润 (单位:人民币元)	176,606,325.57
	截止基准日按照基金合同约定的分红比例计算的应分配金额 (单位:人民币元)	78,178,900.33
本次分红方案 (单位:元/10份基金份额)		3.50
有关年度分红次数的说明		本次分红为2015年度的第一次分红

注:本基金合同约定,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的50%。本基金2015年度可供分配收益为156,357,800.66元,按照基金合同约定的分红比例计算,本基金2015年度应分配金额为78,178,900.33元。本次收益分配方案已经本基金的托管人中国工商银行股份有限公司复核。

2 与分红相关的其他信息

权益登记日	2016年2月1日
除息日	2016年2月2日
现金红利发放日	2016年2月4日
分红对象	权益登记日在本基金注册登记机构登记在册的本基金基金份额持有人,权益登记日当天有效申购基金份额享有红利分配权,权益登记日当天有效赎回基金份额不享有红利分配权。
红利再投资相关事项的说明	选择红利再投资方式的投资者所得再投资基金份额的计算基准为2016年2月2日的基金份额净值,自2016年2月4日起投资者可以办理该部分基金份额的查询、赎回业务。
税收相关事项的说明	根据财政部、国家税务总局相关规定,基金向投资者分配的基金收益,暂免征收所得税。
费用相关事项的说明	本基金本次分红免收分红手续费。 选择红利再投资方式的投资者其红利所转换的基金份额免收申购费用。

3 其他需要提示的事项

1、对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式为现金方式。

2、投资者可以在每个基金开放日的交易时间内到销售网点修改分红方式,本次分红确认的分红方式将按照投资者在权益登记日之前(含权益登记日)最后一次选择的分红方式为准。

3、投资者可以登陆富国基金管理有限公司网站www.fullgoal.com.cn或拨打富国基金管理有限公司客户服务热线95105686、4008880688(全国统一,均免长途费)进行相关咨询。

4、风险提示

本基金分红并不改变本基金的风险收益特征,也不会因此降低基金投资风险或提高基金投资收益。本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资者注意投资风险。

富国基金管理有限公司
2016年1月29日

富国中证移动互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")中关于不定期份额折算的相关规定,当富国移动互联网B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下时,富国移动互联网份额(场内简称:移动互联,基础份额,基金代码:161025)、富国移动互联网A份额(场内简称:互联网A,基金代码:150194)、富国移动互联网B份额(场内简称:互联网B,基金代码:150195)将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2016年1月28日,互联网B的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件,因此本基金管理人敬请投资者密切关注互联网B近期的参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于互联网A、互联网B折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,互联网A、互联网B的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、互联网B表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日,互联网B的份额参考净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,此折算基准日互联网B的份额参考净值可能与折算阈值0.250元有一定差异。

四、互联网A表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后互联网A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征的互联网A变为同时持有较低风险收益特征的互联网A与较高风险收益特征富国移动互联网份额的情况,因此互联网A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量富国移动互联网份额、富国移动互联网A份额、富国移动互联网B份额的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停互联网A与互联网B的上市交易和富国移动互联网份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的基金合同及《富国中证移动互联网指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书")或者拨打本公司客服电话:400-888-0688(免长途话费)。

三、本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,也不保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。投资有风险,选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

富国基金管理有限公司
2016年1月29日

富国中证移动互联网指数分级证券投资基金之互联网B交易价格波动提示公告

近期,富国基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")旗下富国中证移动互联网指数分级证券投资基金之富国移动互联网B份额(场内简称:互联网B;交易代码:150195)二级市场交易价格连续大幅下跌,2016年1月27日,互联网B二级市场收盘价为0.462元,相对于当日0.393元的基金份额参考净值,溢价幅度达到17.56%。截止2016年1月28日,互联网B二级市场收盘价为0.416元,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失。

为此,本基金管理人提示如下:

1、富国移动互联网B份额表现为高风险、高收益的特征。由于富国移动互联网B份额内含杠杆机制的设计,富国移动互联网B份额参考净值的变动幅度将大于富国移动互联网份额(场内简称:移动互联,场内代码:161025)净值和富国移动互联网A份额(场内简称:互联网A,场内代码:150194)参考净值的变动幅度,即富国移动互联网B份额的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。富国移动互联网B份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、富国移动互联网B份额的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。

3、截至2016年1月28日收盘,富国移动互联网B份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值。不定期份额折算后,富国移动互联网B份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日,富国中证移动互联网指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日,富国中证移动互联网指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

6、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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

富国基金管理有限公司
2016年1月29日

富国基金管理有限公司关于调整旗下基金长期停牌股票估值方法的公告

为保护投资者的利益,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》(中国证监会[2008]38号公告)以及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)的原则和有关要求,富国基金管理有限公司(以下简称"本公司")与基金托管银行协商一致,决定对本公司旗下基金持有的"长电科技"(证券代码:600584)、"迪森股份"(证券代码:300335)、"游