（上接B21版）

法定代表人：路瑶
联系人：侯英建
联系电话：010-65807865
客服电话：010-65807609
网址：www.cifcofund.com
（88）中天嘉华基金销售有限公司
注册地址：北京市石景山区八大处高科技西井路3号3号楼7457房间
办公地址：北京市朝阳区京顺路5号曙光大厦C座1层
法定代表人：黄俊辉
联系人：张立新
联系电话：010-58276785
客服电话：400-650-9972
网址：www.sinowel.com
（89）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人：杨涛
联系人：周君
联系电话：010-53570568
客服电话：400-819-9868
网址：www.tdyhfund.com
（90）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1号楼12层1208号
办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
法定代表人：罗细安
联系人：李皓
联系电话：13521165454
客服电话：400-001-8811
网址：www.zengcaiwang.com
（91）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16楼B单元
法定代表人：刘惠
联系人：冯立
联系电话：021-80133535
客服电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
（92）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址：上海浦东杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人：申健
联系人：付江
联系电话：021-20219988*31781
客服电话：020-20219931
网址：https://8.gw.com.cn/
（93）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*8318
客服电话：4008202819
网站：fund.bundtrade.com
（94）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路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
客户服务电话：4008219031
网址：www.lufunds.com
（95）北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人：董浩
联系人：张婷婷
电话：010-66045608
传真：010-66045500
客户服务电话：400-068-1176
网址：www.jimufund.com
（96）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：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788
网址：www.66zichan.com
（97）君德汇富投资咨询有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人：李振
联系人：魏尧
电话：010-65181028
传真：010-65174782/65231189
客服电话：400-066-9355
网址：www.kstreasure.com
（98）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：李晓玥
电话：021-63333319
传真：021-63332523
客户服务电话：4000 178 000
网址：www.lingxianfund.com
（99）北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人：梁洪军
联系人：李长军
电话：010-52609656
传真：010-51957430
客户服务电话：400-819-6665
网址：www.buyforyou.com.cn
（100）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（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贸
联系人 刘勇
电话：0755-83999907-813
传真：0755-83999926
客户服务电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn
（101）汉口银行股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区建设大道933号
办公地址：湖北省武汉市江汉区建设大道933号
法定代表人：陈新民
联系人：李欣
电话：027-82656704
传真：027-82656236
客服电话：96558（武汉）4006096558（全国）
网址：www.hkbchina.com
（102）晋商银行股份有限公司
注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦A座
办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦A座
法定代表人：阎俊生
联系人：杨瑞
电话：0351-6819579
传真：0351-6819926
客服电话：9510-5588
网址：www.jshbank.com
（103）东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号
办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号
法定代表人：何沛良
联系人：林培珊
电话：0769-22866254
传真：0679-22866282
客服电话：0769-961122
网址：www.drcbank.com
（104）齐商银行股份有限公司
注册地址：山东省淄博市张店区金晶大道105号
办公地址：山东省淄博市张店区金晶大道105号
法定代表人：吴传勇
联系人：郭媛媛
电话：0533-2178888-9535
传真：0533-2163766
客服电话：400-86-96588
网址：www.qsbank.cc
（105）德州银行股份有限公司
注册地址：山东省德州市三八东路1266号
办公地址：山东省德州市三八东路1266号
法定代表人：孙玉芝
联系人：王方震
电话：0534-2297326
传真：0533-2297327
客服电话：40084-96588
网址：www.dzbchina.com
（106）威海市商业银行股份有限公司
注册地址：威海市宝泉路9号
办公地址：威海市宝泉路9号
法定代表人：谭先国
联系人：刘文静
电话：0631-5211651
传真：0631-5215726
客服电话：40000-96636
网址：http://www.whccb.com/
（107）天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址：湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座4楼
法定代表人：余磊
联系电话：（027）87618889
传真：（027）87618882
联系人：刘鑫
客服电话：（027）87618889
公司网址：http://www.tfzq.com
（108）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
联系人：刘玲
电话：021-52629999
客服电话：95561
网址：www.cib.com.cn
基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。
（二）H类基金份额发售机构
1、H类基金份额香港代表
工银瑞信资产管理(国际)有限公司
注册地址：香港中环花园道3号中国工商银行大厦8楼801室
办公地址：香港中环花园道3号中国工商银行大厦8楼801室
联系电话：(852)3975 3675
网址：www.icbccs.com.hk
2、H类基金份额的香港销售机构详见本基金的香港说明文件。
（三）注册登记机构
名 称：工银瑞信基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层
法定代表人：郭特华
全国统一客户服务电话：400-811-9999
传 真：010-66583100
联系人：朱辉毅
（四）律师事务所及经办律师
名 称：北京市通商律师事务所
住 所：北京市朝阳区建国门外大街甲12号新华保险大厦606
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街甲12号新华保险大厦606
负责人：韩小京
电 话：（010）65693399
传 真：（010）65693838
经办律师：张晓彤、胡雪蓉
（五）会计师事务所及经办注册会计师
名 称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住 所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城，东三办公楼16层
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城，东三办公楼16层
法定代表人：葛明
经办注册会计师：王静、王珊珊
联系电话：（010）58815245
传真：（010）58114645
联系人：王珊珊

四、基金的名称

本基金名称：工银瑞信核心价值混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：混合型基金

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为有效控制投资组合风险，追求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

八、基金的投资策略

1. 资产配置

本基金充分借鉴瑞士信贷资产管理公司的资产配置理念，发展了针对中国资本市场的工银瑞信资产配置模型，运用国际化的视野审视中国经济和资本市场，采取自上而下的方法，定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。

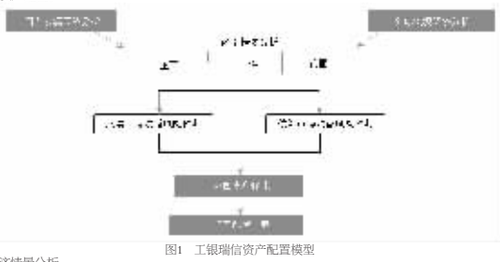


图1 工银瑞信资产配置模型

（1）经济情景分析

本基金定期评估宏观经济和投资环境，结合瑞士信贷资产管理公司的全球宏观经济研究资源，对全球及国内经济发展进行评估和展望。确定未来市场发展的主要推动因素，预测关键的经济变量，以及中国资本市场相对于海外市场的风险溢价。判断未来宏观经济的三个可能的情景（正面，中性，负面），并给出每个情景发生的概率。

（2）类别资产收益风险预期

针对宏观经济未来三个可能的预期情景，分别预测股票和债券类资产未来的收益和风险，并对每类资产未来收益的稳定性进行评估。将每类资产的预期收益与目前的市场情况进行对比，揭示未来收益可能发生的结构性变化，并对这一变化进行评估。

（3）数量模型优化

运用工银瑞信资产配置模型数量分析模块，根据股票和债券资产的预期收益和风险，进行资产配置比例的优化，得到股票和债券类资产的配置比例，给出相关报告。

（4）制定资产配置方案

结合上述步骤中的分析结果，拟定资产配置方案，作为投资决策委员会进行资产配置决策的重要依据。

2. 行业配置策略

本基金根据各行业所处生命周期、行业竞争结构、行业景气度变动趋势等因素，对各行业的相对投资价值进行综合分析，挑选优势行业和景气行业，进行重点投资。本基金行业配置流程如下：

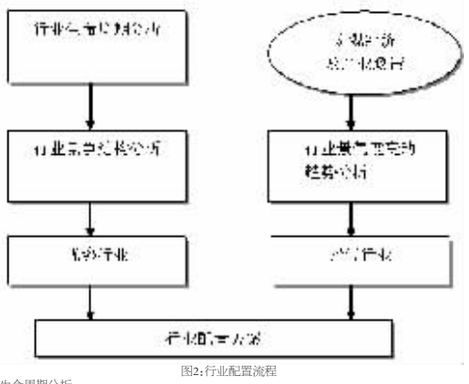


图2：行业配置流程

（1）行业生命周期分析

对每一个行业，分析其所处生命周期阶段。本基金将重点投资处于增长期与成熟期的行业，对这些行业给予较高评分，而对处于发育期的行业保持谨慎投资，给予较低的评分，对处于衰退期的行业避免投资。但是，某些行业虽然从大类行业看属于衰退性行业，其中某些细分行业仍然处于增长期或者成熟期，具有较好的发展前景或较强的盈利能力，本基金将对这些细分行业的公司进行投资。

（2）行业竞争结构分析

本基金重点从以下几个方面考察各行业的竞争结构，分析各行业的盈利能力：1）产品定价能力；2）上游行业谈判能力；3）行业进入壁垒；4）技术、产品的可替代性；5）行业内部竞争状况等。本基金重点投资那些拥有特定垄断资源，或具有不可替代性技术或资源优势，具有较高进入壁垒，或者具有较强定价能力，利润率较高的行业。

（3）行业景气度变动趋势分析

本基金将分析各个行业在国民经济所处不同运行阶段的表现情况，分析国家宏观经济政策对这些行业的影响程度，利用反映各行业发展状况的主要指标，例如，产量、开工率、投资额、价格及其变化趋势等指标，判断各行业在近中期的景气度。对那些近中期所处宏观经济环境有利，尤其是进入景气度拐点性好转的行业给予较高的评分，而对那些近中期所处宏观经济环境不利、尤其是受宏观经济政策负面影响较大、进入景气度下降通道的行业给予较低的评分。

（4）确定行业配置方案

在上述分析的基础上，结合本基金的风险收益特征，综合分析各行业近中期的相对投资价值，挑选出那些具有较好发展前景及较强盈利能力的优势行业，以及那些随着国民经济运行周期变动，进入景气度好转或者处于景气度上升阶段的景气行业，进行重点投资。

3. 股票投资策略

本基金借鉴瑞士信贷资产管理公司股票投资理念和经验，运用价值投资理念，按照品质扫描、竞争优势评价和价值评估的股票选择流程，投资于经营稳健、具有核心竞争优势、价值被低估的大中型上市公司股票。

本基金股票选择流程如下：

（1）品质扫描

本基金的股票资产将主要投资于经营稳健、质地优良的大中型上市公司，因此在股票的评定上将严格按照市值规模、盈利能力和流动性三方面的要求对股票市场进行全市场扫描，筛选出在市值规模、盈利能力、流动性等品质上符合基本要求的上市公司。

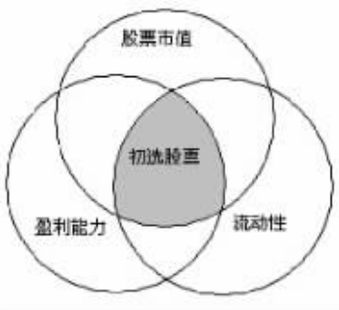


图4 工银瑞信股票品质扫描

针对那些扫描进来的股票，本基金还将利用市场公开信息和公司研究数据库，对企业进行进一步诊断，包括企业基本情况和财务状况等。通过企业诊断，剔除那些价格被操纵、有频繁资本运作迹象的企业，以及那些业务结构明显不合理、经营风险与财务风险过高，或有严重违法迹象的企业。

（2）竞争优势评价

本基金将从企业的基本战略、产品市场份额、成本状况、技术水平及创新能力、以及企业的经营管理水平等多方面，考察企业在行业中的竞争地位。本基金重点投资于那些在行业中居于领先地位，在成本、技术水平及创新能力等方面拥有核心竞争优势的企业。

（3）价值评估

本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法对上市公司进行价值评估。定量分析主要采用现金流折现模型、相对估值法等方法评估上市公司的市场价值。价值评估将考虑公司的业务发展规划与前景、公司各项主要业务的市场份额及增长趋势，公司资本结构及经营风险水平等多种因素。

在对上市公司进行价值评估的基础上，将上市公司股票内在价值与市场价格进行比较，寻找被市场低估的股票进行投资，构建投资组合。

4. 债券投资策略

本基金采取“自上而下”的债券投资策略，深入分析宏观经济、经济政策和市场结构调整等因素对债券市场的影响，判断债券市场走势，运用久期管理策略、收益率曲线策略、收益率利差策略等投资策略，结合债券信用风险管理和流动性管理，构建收益稳定、流动性良好的债券资产组合。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率。

沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为成份股，较好地反映了A股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，该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，能够全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

本基金是混合型证券投资基金，股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%，债券及现金资产占基金资产净值的比例为5%－40%，本基金对沪深300指数和中证综合债券指数分别赋予75%和25%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后证券市场中有其他代表性更强的业绩比较基准推出，或者有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人将在调整前3个工作日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金，一般情况下，其风险及预期收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

本报告期为2015年7月1日起至9月30日止。（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	3,387,807,519.74	81.56
	其中：股票	3,387,807,519.74	81.56
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	500,000,870.00	12.04
	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	260,657,931.92	6.28
8	其他资产	5,423,448.41	0.13
9	合计	4,153,889,770.07	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	129,684,458.15	3.13
C	制造业	1,678,146,009.04	40.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,997,720.00	0.87
E	建筑业	7,890,000.00	0.19
F	批发和零售业	182,293,395.39	4.40
G	交通运输、仓储和邮政业	17,660,000.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	537,970,243.63	12.99
J	金融业	291,584,383.67	7.04
K	房地产业	278,014,434.40	6.71
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	42,659,502.30	1.03
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	185,907,373.16	4.49
S	综合	-	-
	合计	3,387,807,519.74	81.82

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	002439	启明星辰	11,917,458	301,511,687.40	7.28
2	600498	烽火通信	12,395,006	263,641,777.62	6.37
3	600266	北京城建	15,092,883	174,926,513.97	4.22
4	002475	立讯精密	4,778,700	140,254,845.00	3.39
5	300144	宋城演艺	4,814,762	108,717,325.96	2.63
6	600153	建发股份	8,923,907	101,197,105.38	2.44
7	601288	农业银行	30,000,000	90,900,000.00	2.20
8	601009	南京银行	5,718,501	82,975,449.51	2.00
9	300230	永利带业	4,199,997	81,269,941.95	1.96
10	600694	大商股份	2,411,427	81,096,290.01	1.96

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。

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。

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

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序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

9.1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持有股指期货投资，也无期间损益。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

10.2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持有国债期货投资，也无期间损益。

10.3本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

11投资组合报告附注

11.1 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。

11.2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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,823,094.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	174,436.02
5	应收申购款	2,425,917.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,423,448.41

11.4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可转换债券。

11.5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	002475	立讯精密	140,254,845.00	3.39	非公开发行
2	600153	建发股份	101,197,105.38	2.44	重大事项
3	300230	永利带业	81,269,941.95	1.96	重大事项

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十二、基金的业绩

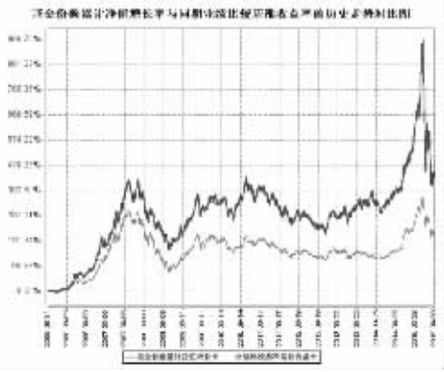
基金管理人承诺以格尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金合同生效日为2005年8月31日，基金合同生效以来（截至2015年9月30日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

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
2005.8.31-2005.12.31	1.56%	0.35%	1.04%	0.70%	0.52%	-0.35%
2006年	142.69%	1.42%	83.94%	1.05%	58.75%	0.37%
2007年	100.39%	1.94%	107.66%	1.72%	-7.27%	0.22%
2008年	-41.07%	1.91%	-52.10%	2.25%	11.03%	-0.34%
2009年	57.49%	1.45%	66.73%	1.53%	-9.24%	-0.08%
2010年	5.67%	1.38%	-7.47%	1.18%	13.14%	0.20%
2011年	-23.65%	1.24%	-18.87%	0.97%	-4.78%	0.27%
2012年	3.70%	1.26%	6.83%	0.94%	-3.13%	0.32%
2013年	15.44%	1.34%	-3.31%	1.03%	18.75%	0.31%
2014年	30.45%	1.28%	38.33%	0.89%	-7.88%	0.39%
2015.1.1-2015.9.30	-5.89%	3.04%	-4.04%	1.99%	-1.85%	1.05%
自基金合同生效日起至今	443.49%	1.64%	217.26%	1.40%	226.23%	0.24%

2、本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

（2005年8月31日至2015年9月30日）



注：1、本基金基金合同于2005年8月31日生效。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定；本基金股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%，债券及现金资产占基金资产净值的比例为5%－40%。

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。

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

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二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，基金托管人复核后于次月首日起二个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金对A类份额的申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过1.5%，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

申购金额（M）	A类份额的申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	1.0%
500万≤M<1000万	0.8%
M≥1000万	按笔收取，1000元/笔

本基金对H类份额的申购收取不超过申购金额3%的申购费，由香港销售机构在此范围内自行确定。

申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

2、赎回费

持有期限	A类份额赎回费率	H类份额赎回费率
持有期<1年	0.5%	0.125%
1年≤持有期<2年	0.25%	
持有期M≥2年	全免	

注：1年指365天。

赎回费用由赎回人承担，A类份额赎回费中25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费，H类份额的赎回费100%归入基金资产。

3、转换费

本基金的转换费用的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式详见本公司相关公告。

4、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率、转换费率或收费方式，并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

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）等定期或不定期地开展基金促销活动。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《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，主要更新的内容如下：

1、在“二、释义”部分，增加了相关信息。

2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关信息。

3、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息。

4、在“五、相关服务机构”部分，更新了相关服务机构的相关信息。

5、在“六、基金的募集”部分，增加了基金份额的类别相关内容。

6、在“七、基金合同的生效”部分，更新了相关信息。

7、在“八、基金份额的申购与赎回”部分，更新了基金份额申购与赎回的相关信息。

8、在“九、基金的投资”部分，更新了本基金业绩比较基准、投资禁止行为与限制和最近一期投资组合报告的内容。

8、在“十、基金的业绩”部分，更新了截至2015年9月30日基金的业绩。

9、在“十二、基金财产的估值”部分，更新了基金财产的估值相关信息。

10、在“十三、基金的收益与分配”部分，更新了收益分配原则相关内容。

11、在“十四、基金的费用与税收”部分，更新了基金托管人的基金托管费相关信息。

12、在“十六、基金的信息披露”部分，更新了临时报告与公告相关信息。

13、在“十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”部分，更新了相关信息。

14、在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分，更新了电子化交易的相关信息。

15、在“二十二、其他应披露的事项”部分，列出了本次更新内容期间与本基金相关的公告。

16、在“附件一 基金合同摘要”部分，更新了相关信息。

17、在“附件二 基金托管协议摘要”部分，更新了相关信息。

工银瑞信基金管理有限公司
二〇一六年二月二十二日

证券代码：000686 证券简称：东北证券 公告编号：2016-030

东北证券股份有限公司关于《公司章程》变更及换领新《企业法人营业执照》和《经营证券业务许可证》的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2015年7月8日，公司收到中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于核准东北证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》(证监许可[2015]1565号)，核准公司设立东证融汇证券资产管理有限公司，并核准公司变更业务范围，减少证券资产管理业务。根据公司2014年第五次临时股东大会决议及中国证监会上述批复，公司对《章程》第十三条进行了相应修改，具体如下：

原文：

经依法登记，公司的经营范围：证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；中国证监会批准的其他业务。

公司变更业务范围必须经中国证监会批准，依照法定程序修改公司章程并在公司登记机关办理变更登记。

现修改为：

经依法登记，公司的经营范围：证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；中国证监会批准的其他业务。

公司变更业务范围必须经中国证监会批准，依照法定程序修改公司章程并在公司登记机关办理变更登记。

日前，公司已办理完成工商变更登记手续，换领了新的《企业法人营业执照》，并向中国证监会申请换领了《经营证券业务许可证》，经营范围减少证券资产管理业务。

修订后的公司《章程》与本公告同日刊载于巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）。

特此公告。

东北证券股份有限公司董事会
二〇一六年二月二十二日

证券代码：000686 证券简称：东北证券 公告编号：2016-029

东北证券股份有限公司关于资产管理子公司成立暨开展证券资产管理业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

公司于2014年11月14日召开的第八届董事会2014年第八次临时会议及于2014年12月1日召开的2014年第五次临时股东大会审议通过了《设立资产管理子公司并变更公司经营范围的议案》。2015年7月8日，公司收到中国证券监督管理委员会《关于核准东北证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》(证监许可[2015]1565号)，核准公司设立东证融汇证券资产管理有限公司。详细内容可参见公司在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《东北证券股份有限公司关于获准设立资产管理子公司的公告》（2015-056）。

日前，东证融汇证券资产管理有限公司已经完成工商登记，并领取了《经营证券业务许可证》，该全资子公司注册资本为人民币5亿元，业务范围为证券资产管理业务，住所为上海市浦东新区新金桥路255号540室。

特此公告。

东北证券股份有限公司董事会
二〇一六年二月二十二日

博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通交通银行、邮储银行、兴业银行、光大银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告

为方便投资者通过直销网上交易方式投资博时基金管理有限公司（以下简称“本公司”）所管理的开放式基金，本公司与上海富友支付服务有限公司（以下简称“富友支付”）合作，自2016年2月22日起面向交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）、中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“邮储银行”）、中国光大银行股份有限公司（以下简称“光大银行”）、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）借记卡持卡人推出基金直销网上交易业务。持有交通银行、邮储银行、兴业银行、光大银行借记卡的个人投资者可通过富友支付在本公司直销网上系统办理基金账户开户及本公司管理的开放式基金的交易、支付、查询等业务，并享受本公告公布的网上交易优惠申购费率。

现将有关事项公告如下：

一、适用投资者

持有交通银行、邮储银行、兴业银行、光大银行借记卡的个人投资者。

二、适用基金范围

本公司所管理的已开通直销网上交易方式的开放式基金。

三、适用业务范围

基金开户、认购、申购、定期投资、赎回、转换、撤单、修改分红方式等业务。

投资者通过直销网上交易办理上述业务时，应符合有关法律法规的要求与各基金的基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

四、直销网上交易申购业务优惠费率

适用投资者使用交通银行、邮储银行、兴业银行、光大银行借记卡通过富友支付在本公司直销网上系统开立交易账户，本公司对该交易账户下通过富友进行支付的申购、定投、转换交易给予优惠费率，优惠费率折扣见下表：

渠道	申购	转换	定期定投
交通银行	4折	4折	4折
邮储银行	4折	4折	4折
兴业银行	4折	4折	4折
光大银行	4折	4折	4折

注：转换和定期转换的折扣系数适用于计算转换费用中的申购费补差。

优惠费率为适用基金最新公告中披露的原申购费率乘以相应折扣(即实收费率＝原费率×折扣系数)，按此标准计算的优惠费率如果低于或等于0.6%，则按0.6%执行；原费率低于0.6%的，则执行该基金原费率。

优惠申购费率适用于本公司所管理的已开通直销网上交易申购业务且申购费率不为零的前端收费模式的开放式基金。

通过本公司直销网上系统办理货币市场基金转换为其他开放式基金的转换和定期转换业务，优惠费率以2015年1月24日公告的《博时基金管理有限公司关于直销网上交易对货币市场基金转换业务申购费补差优惠的公告》为准。

五、本公司直销网上交易系统指：博时快e通（网址为trade.bosera.com）、博时移动版交易系统（网址为m.bosera.com）、博时直销网上交易系统APP版

六、本公告有关基金直销网上交易业务的解释权归本公司所有。

七、风险提示

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。敬请投资人注意投资风险。

投资者申请使用网上交易业务前，应认真阅读有关网上交易协议、相关规则，投资者应慎重选择，并在使用时妥善保管好网上交易信息，特别是账号和密码。

开通网上交易业务详情可登录本公司网站www.bosera.com参阅《博时基金管理有限公司网上交易指南》，投资者也可拨打博时一线通：95105568（免长途费）了解或咨询相关情况。

特此公告。

博时基金管理有限公司
2016年2月22日

证券代码：002226 证券简称：江南化工 公告编号：2016-009

安徽江南化工股份有限公司股价异动公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动情况

安徽江南化工股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")股票(证券简称：江南化工