（上接B79版）

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：梁丽金、刘佳

（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

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

股票型

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证500指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及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，股票资产投资比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股、力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。

1、标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为中证500指数。中证500指数是中证指数有限公司为反映市场上不同规模特征股票的整体表现，以沪深 300 指数为基础，构建的包括大盘、中盘、小盘、大中盘、中小盘和大中小盘指数在内的规模指数体系中的组成部分。中证500指数全称“中证小盘500指数”，它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

如果中证500指数被停止编制及发布，或中证500指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证500指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人将于变更后在中国证监会指定的媒体上公告。

2、指数化投资为主，主动性投资为辅：

本基金主要策略为复制目标指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。

富国研发的定量投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子alpha模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。

（1）多因子alpha模型——股票超额回报预测

富国多因子alpha模型以对中国股票市场的长期研究为基础，一定程度上结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha模型的因子可归为如下几类：价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)。

这些类别综合了来自市场各类投资者，公司各类报表，分析师及监管政策等各方面信息。富国多因子alpha模型利用富国长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。

（2）风险估测模型——有效控制风险预算

指数化投资力求跟踪误差最小，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，有效将投资组合风险控制在预算范围内。

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

（3）交易成本模型——控制成本并保护业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，在控制成本最低的基础上减少交易造成的负业绩影响。

（4）投资组合优化模型

本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将以成份股为主，并包括非成份股中与成份股相关性强、流动性好，基本面信息充足的股票。

3、对目标指数的跟踪调整：

（1）定期调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。中证指数公司每半年审核一次中证500指数成份股。本基金将按照中证500指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

（2）不定期调整

根据指数编制规则，当中证500指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日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。

调整期间原则上定为：中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将采用合理方法寻求替代。由于受到各项投资禁止行为以及持股比例等限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时也需要寻求替代。

4、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准＝95%×中证500指数收益率＋1%（指年收益率，评价时按期间折算）。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

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	311,628,029.28	97.67
	其中：股票	311,628,029.28	97.67
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	20,306,320.26	6.02
7	其他资产	5,207,936.70	1.54
8	合计	337,142,286.24	104.40

2、报告期末积极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	2,474,745.00	0.71
B	采矿业	—	—
C	制造业	32,031,883.85	9.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,440.00	0.02
E	建筑业	2,128,577.48	0.61
F	批发和零售业	1,222,591.00	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,499,085.04	2.72
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,488,507.00	0.43
L	租赁和商务服务业	616,197.46	0.18
M	科学研究和技术服务业	611,610.00	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,205,142.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,093,606.16	0.31
R	文化、体育和娱乐业	2,019,746.12	0.58
S	综合	—	—
	合计	57,784,057.35	16.54

3、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	6,764,429.00	1.94
B	采矿业	10,301,960.50	2.95
C	制造业	154,044,314.74	44.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,160,718.14	1.76
E	建筑业	7,287,194.06	2.09
F	批发和零售业	14,261,348.18	3.70
G	交通运输、仓储和邮政业	6,158,522.16	1.76
H	住宿和餐饮业	237,373.09	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,082,923.04	4.50
J	金融业	2,955,846.40	0.85
K	房地产业	19,772,556.91	5.66
L	租赁和商务服务业	3,506,442.60	0.76
M	科学研究和技术服务业	302,918.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,993,304.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	2,486,081.25	0.71
R	文化、体育和娱乐业	3,148,662.15	1.42
S	综合	2,695,303.95	0.77
	合计	255,521,605.25	73.14

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（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	600537	亿晶光电	276,160	3,949,088.00	1.18
2	600026	中海发展	587,400	3,900,336.00	1.16
3	002190	成飞集成	98,000	3,567,200.00	1.06
4	600079	人福医药	173,700	3,230,820.00	0.96
5	600894	广日股份	203,800	3,222,078.00	0.96
6	600112	天成控股	251,104	3,176,465.60	0.95
7	600458	时代新材	216,300	3,106,068.00	0.93
8	300267	尔康制药	98,000	2,955,680.00	0.88
9	002503	搜于特	180,200	2,730,030.00	0.81
10	600572	康恩贝	253,310	2,705,350.80	0.81

（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

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	600637	东方明珠	100,500	2,879,325.00	0.86
2	300498	温氏股份	48,100	2,474,745.00	0.74
3	600285	羚锐制药	204,100	2,092,025.00	0.62
4	300144	宋城演艺	67,562	1,976,864.12	0.59
5	300287	飞利信	125,050	1,675,670.00	0.50

5、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。

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五名债券投资明细

注：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。

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

10、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

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

11、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

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

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。

12、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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“华海药业”的发行主体浙江华海药业股份有限公司（以下简称“公司”）于2015年6月10日因项目未经环评批复先行建设被临海市环境保护局以临环罚字［2015］63号《行政处罚决定书》处以责令停止未批项目建设（生产）、罚款人民币6万元的处罚；公司于2015年7月23日因川南一分厂不正常使用大气污染物处理设施的行为被临海市环境保护局以临环罚字［2015］108号《行政处罚决定书》处以责令停止违法行为和罚款人民币5万元的处罚；公司于2015年7月24日因川南一分厂废水超标排放被临海市环境保护局以临环罚字［2015］119号《行政处罚决定书》处以责令停止违法行为、罚款人民币58.6万元的处罚。

华海药业为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余九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。

（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。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	180,451.88
2	应收证券清算款	4,136,525.91
3	应收股利	—
4	应收利息	5,975.85
5	应收申购款	884,983.06
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,207,936.70

（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

1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	300287	飞利信	1,675,670.00	0.50	筹划重大事项

（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。

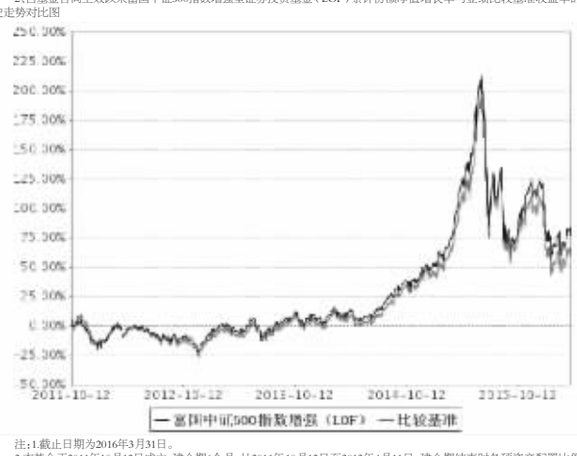
十二、基金的业绩

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、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准比较表

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
2011.10.12-2011.12.31	-15.10%	1.33%	-13.54%	1.65%	-1.56%	-0.32%
2012.1.1-2012.12.31	7.77%	1.45%	1.41%	1.46%	6.36%	-0.01%
2013.1.1-2013.12.31	16.61%	1.38%	17.28%	1.37%	-0.67%	0.01%
2014.1.1-2014.12.31	38.71%	1.14%	38.23%	1.18%	0.48%	-0.04%
2015.1.1-2015.12.31	47.03%	2.62%	42.66%	2.68%	4.37%	-0.06%
2016.1.1-2016.3.31	-15.58%	3.03%	-17.99%	3.08%	2.41%	-0.05%
2011.10.12-2016.3.31	83.70%	1.82%	66.31%	1.86%	17.39%	-0.04%

2、自基金合同生效以来富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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



注：1.截止日期为2016年3月31日。

2.本基金于2011年10月12日成立，建仓期6个月，从2011年10月12日至2012年4月11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

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）基金合同生效后的信息披露费用；

（4）基金上市费及年费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金的指数使用费；

（9）基金财产拨划支付的银行费用；

（10）证券账户开户费用和银行账户维护费；

（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。

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

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

在通常情况下，基金管理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×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为1%

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于次月首日起3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、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。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管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×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.15%

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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。指数许可使用费在通常情况下按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

H=E×0.016%÷当年天数

H为每日应付的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元。

由于中证指数有限公司保留变更或提高指数使用费的权利，如果指数使用费的计算方法、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《信息披露办法》的规定在指定媒体进行公告。

（4）上述(一)中3到10项费用由基金托管人根据其他有关法律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

1、申购费率

（1）本基金的场外申购费率

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）投资者选择交纳前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。

本基金前端收费模式对通过直销柜台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。

A、前端申购费率

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元（含）—500万元	1.2%
500万元（含）以上	1000元/笔

注：上述前端申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户外的其他选择前端收费模式的投资者。

B、特定申购费率

购买金额（M，含申购费）	特定申购费率
M<100万	0.45%
100万≤M<500万	0.36%
500万≤M	每笔1000元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台、以前端收费模式申购的养老金客户，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：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；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。

2）投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	后端申购费率
1年以内（含）	1.6%
1年-3年（含）	1.0%
3年-5年（含）	0.5%
5年以上	0

各销售机构销售本基金时采取的收费模式以其业务规定为准。实际办理过程中根据支付渠道不同可能存在限制办理后端申购模式的情况，具体以实际网上交易页面相关说明为准。

（2）本基金的场内申购费率由基金代销机构比照场外申购费率执行。

（3）本基金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、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

2、赎回费率

本基金根据投资者申购方式采用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端申购费用时，适用固定的赎回费率，定为0.5%。

投资者选择交纳后端申购费用时，适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	赎回费率
2年以内（含）	0.6%
2年-3年（含）	0.3%
3年以上	0

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、注册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

（1）前端转前端

前端基金转换费用将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当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，补差费为零。

（2）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。

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

注：a、转换的两只基金必须都是注册登记在深圳中登下的、且同一收费模式的开放式基金。

b、对于养老金客户基金转换，如在实施特定申购费率的基金间转换，则按特定申购费率之间的价差进行补差，如转换的两只基金中至少有一支为非实施特定申购费率的基金，则按照原申购费率之间的价差进行补差。

c、转换份额的计算结果保留到小数点后2位。

4、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调低申购费率、赎回费率或调整收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。

5、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）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（三）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关法律法规的规定进行公告或备案。

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》、《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”部分更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

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、“十、基金的投资”部分更新了投资组合报告，内容截止至2016年3月31日。

6、“十一、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2016年3月31日，并更新了历史走势对比图。

7、对“二十二、对基金份额持有人的服务”部分进行了更新。

8、“二十三、其它应披露事项”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

二〇一六年五月二十四日

证券代码：600820　证券简称：隧道股份　公告编号：2016-015

债券代码：122032　债券简称：09隧道债

上海隧道工程股份有限公司2015年年度股东大会决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

●本次会议是否有否决议案：无

一、会议召开和出席情况

(一)股东大会召开的时间：2016年5月23日

(二)股东大会召开的地点：上海市浦东新区迎春路1199号上海证大丽笙酒店2楼木兰厅

(三)出席会议的普通股股东和恢复表决权的优先股股东及其持有股份情况：

1、出席会议的股东和代理人人数	25
2、出席会议的股东所持有表决权的股份总数（股）	1,613,862,758
3、出席会议的股东所持有表决权股份数占公司有表决权股份总数的比例（%）	51.3299

(四)表决方式是否符合《公司法》及《公司章程》的规定，大会主持情况等。

本次股东大会由公司董事会召集，董事长张焰先生主持本次股东大会。会议采取现场及网络相结合的投票方式，符合《中华人民共和国公司法》及《公司章程》的规定。

(五)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况

1、公司在任董事9人，出席5人，董事徐平先生、董事李安女士、独立董事周骏先生、独立董事颜学海先生因工作原因未能出席本次股东大会；

2、公司在任监事5人，出席5人；

3、董事会秘书田军先生出席了本次股东大会；其他部分高级管理人员列席了本次股东大会。

二、议案审议情况

(一)非累积投票议案

1、议案名称：公司2015年度董事会工作报告

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	1,613,778,058	99.9948	75,700	0.0047	9,000	0.0005

2、议案名称：公司2015年度监事会工作报告

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	1,613,778,058	99.9948	75,700	0.0047	9,000	0.0005

3、议案名称：公司2015年度财务决算及2016年度财务预算报告

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	1,601,103,875	99.2094	12,749,883	0.7900	9,000	0.0006

4、议案名称：公司2015年度利润分配预案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	1,613,778,058	99.9948	75,700	0.0047	9,000	0.0005

5、议案名称：关于聘任2016年度会计师事务所的预案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	1,613,778,058	99.9948	75,700	0.0047	9,000	0.0005

6、议案名称：关于提请股东大会同意并授权董事会决定工程分包形成的持续性关联交易的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	246,083,878	99.8662	75,700	0.0307	254,100	0.1031

7、议案名称：关于投资杭绍台高速公路(台州段) PPP项目的议案

审议结果：通过

表决情况：

股东类型	同意		反对		弃权	
	票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
A股	1,613,778,058	99.9948	75,700	0.0047	9,000	0.0005

(二)涉及重大事项，5%以下股东的表决情况

议案序号	议案名称	同意		反对		弃权	
		票数	比例（%）	票数	比例（%）	票数	比例（%）
4	公司2015年度利润分配预案	14,016,727	99.3994	75,700	0.5368	9,000	0.0638
6	关于提请股东大会同意并授权董事会决定工程分包形成的持续性关联交易的议案	13,771,627	97.6612	75,700	0.5368	254,100	1.8020

(三)关于议案表决的有关情况说明

大会审议的第六项议案涉及关联交易，关联股东为公司控股股东上海城建（集团）公司，所持表决权股份数量1,367,449,080股，关联股东回避了该项议案的表决。

三、律师见证情况

1、本次股东大会鉴证的律师事务所：上海市金茂律师事务所

律师：吴伯庆、杨红良

2、律师鉴证结论意见：

公司本次股东大会的召集、召开程序符合法律、法规和规范性文件及《公司章程》的规定，出席会议人员和召集人的资格、会议表决程序、表决结果符合法律、法规和规范性文件及《公司章程》的规定，本次股东大会通过的各项决议均合法有效。

四、备查文件目录

1、《上海隧道工程股份有限公司2015年年度股东大会决议》；

2、《上海市金茂律师事务所关于上海隧道工程股份有限公司2015年年度股东大会的法律意见书》。

特此公告。

上海隧道工程股份有限公司

2016年5月24日

证券代码：002797　证券简称：第一创业　公告编号：2016-006

第一创业证券股份有限公司2015年第二期次级债券2016年付息公告

本公司及全体董事、监事、高级管理人员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示：

第一创业证券股份有限公司（以下简称"本公司"）2015年第二期次级债券（以下简称"本期债券"）将于2016年5月27日支付2015年5月27日至2016 年5月26日期间的利息，为确保付息工作的顺利进行，现将有关事宜公告如下：

一、本期债券基本情况

1、私募债券名称：第一创业证券股份有限公司2015年第二期次级债券

2、私募债券简称：15一创02

3、私募债券代码：118930

4、发行总额：人民币8亿元

5、发行方式：本期债券以非公开方式发行，发行后的机构投资者合计不得超过200人

6、发行对象：符合《证券公司次级债管理规定》要求的机构投资者

7、存续期限：3年期固定利率债券

8、票面利率：采用固定利率形式，票面利率5.9%，在本期次级债券存续期内保持不变

9、计息方式：本期债券按年付息，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付

10、还本付息方式：本期债券按年付息，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付

11、起息日：2015年5月27日

12、付息日：2016年5月27日（如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日）

13、本金兑付日：2018年5月27日。前述日期如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间本金不另计利息

14、发行人上调票面利率选择权：无

15、投资者回售选择权：投资者不得提前回售本期债券

16、担保情况：本次债券发行无担保

17、受托管理人：无

18、监管银行：无

19、税务提示：根据国家有关税收法律、法规的规定，投资者投资本期债券所应缴纳的税款由投资者承担

20、本期债券登记、托管、代理债券付息、兑付机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称"中国结算深圳分公司"）。

二、本期债券付息方案

本期债券票面利率为5.9%，每手（面值1,000元）付息金额为人民币59元（含税），扣税后个人、证券投资基金债券持有人每手实际取得的利息为47.2元，扣税后非居民企业（包含QFII、RQFII）每手实际取得的利息为53.1元。

三、债权登记日、除息日及付息日

1、债权登记日：2016年5月26日。

2、除息交易日：2016年5月27日。

3、债券付息日：2016年5月27日。

四、债券付息对象

本次付息对象为：截止2016年5月26日（该日期为债权登记日）下午深圳证券交易所收市后，在中国结算深圳分公司登记在册的全体本期债券持有人。

五、债券付息方法

本公司委托中国结算深圳分公司进行本次债券的派息。

根据本公司向中国结算深圳分公司提交的委托代理债券派息申请，本公司将在本次付息日2个交易日前将本期债券本次派息（兑付）资金足额划付至中国结算深圳分公司指定的银行账户。中国结算深圳分公司收到款项后，通过资金结算系统将本期债券本次派息资金划付给相应的付息网点（由债券持有人指定的证券公司营业部或中国结算深圳分公司认可的其他