（上接B30版）

（64）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法人代表：闫振杰
联系电话：（010）62020088
传真电话：（010）62020088
联系人员：宋丽冉
客服电话：4008886661
公司网站：www.myfund.com
（65）富实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
法人代表：赵学军
联系电话：021-20289890
传真电话：021-20280110
联系人员：张倩
客服电话：400-021-8850
公司网站：www.harvestwm.cn
（66）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
法人代表：梁蓉
联系电话：（010）66154828
传真电话：（010）88067526
联系人员：张旭
客服电话：400-6262-818
公司网站：www.5irich.com
（67）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座3楼
法人代表：燕斌
联系电话：021-52822063
传真电话：021-52975270
联系人员：凌秋艳
客服电话：400-046-6788
公司网站：www.66zichan.com
（68）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
法人代表：陈继武
联系电话：021-63333319
传真电话：021-63332523
联系人员：李晓明
客服电话：4000-178-000
公司网站：www.lingxianfund.com
（69）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
法人代表：郭坚
联系电话：021-20665952
传真电话：021-22066653
联系人员：宁博宇
客服电话：4008219031
公司网站：www.lufunds.com
（70）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12楼B1201-1203
法人代表：肖雯
联系电话：020-89629099
传真电话：020-89629011
联系人员：吴煜浩
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：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：周明
电话：（010）58598839
传真：（010）58598834
联系人：朱立元
（三）出具法律意见书的律师事务所（基金募集时）
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：廖海
经办律师：廖海、黎明
（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

富国天丰强化收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型

六、基金的投资目标

本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造较高的当期收益。

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。

(1)整体资产配置策略

通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，在整体资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2)类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下，根据资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理以及市场流动性等因素，将市场细分为普通债券（含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等）、附权债券（含可转换公司债、各类附权债券等）、资产证券化产品、金融创新（各类金融衍生工具等）和新股申购五个子市场，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数。

(3)明细资产配置策略

在明细资产配置上，首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合；其次，根据个别债券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）与剩余期限的配比，对照基金的收益要求决定是否纳入组合；最后，根据个别债券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定投资总量。

2、普通债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

(1)久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险；

(2)期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3)信用风险控制是管理人充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

(4)跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券债组合，提高投资收益，实现跨市场套利。

(5)相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。

3、附权债券投资策略

附权债券指对债券发行体授予某种期权，或者赋予债券投资者某种期权，从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地，从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性，也增强对各类投资者的吸引力。当前附权债券的主要种类有可转换公司债券、分离交易可转换公司债券以及含赎回或回售选择权的债券等。

(1)可转换公司债券投资策略

可转换公司债券不同于一般的企业（公司）债券，其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值，是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。

可转换公司债券最大的优点在于，可以用较小的本金损失，博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布，买入低转换溢价率的债券，并持有的投资策略，只要在可转换公司债券的存续期内，发行转债的公司股票价格上升，则投资就可以获得超额收益。

可转换公司债券可以按照协议价格转换为上市公司的股票，因此在日常交易过程中可能会出现可转换公司债券市场与股票市场之间的套利机会。本基金持有的可转换公司债券可以转换成股票。基金管理人在日常交易过程中，会密切关注可转换公司债券市场与股票市场之间的互动关系，恰当的选择时机进行套利。

(2)其它附权债券投资策略

本基金利用债券市场收益率数据，运用利率模型，计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差（OAS），作为此类债券投资估值的主要依据。

分离交易可转换公司债券，是认股权证和公司债券的组合产品，该种产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证自可交易之日起30个交易日内全部卖出。分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

4、资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构化安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

5、新股申购策略

为保证新股发行成功，新股发行一级市场价格通常相对二级市场价格存在一定的折价。在中国证券市场发展历程中，参与新股申购是一种风险低、收益稳定的投资行为，为投资人带来较高的投资回报。本基金根据新股发行人的基本情况，以及对认购中签率和新股上市后表现的预期，谨慎参与新股申购，获取股票一级市场与二级市场的价差收益，申购所得的股票在可上市交易后30个交易日内全部卖出。

主动性投资策略的制定与贯彻的过程，也是管理人对于风险进行动态评估与管理的过程。对风险定价失效机会的把握充分体现了主动性投资策略的特点。在系统化的风险控制体系下，通过对管理指标的设定与监控，管理人不但可以有效控制整体资产的风险水平，而且可以在寻求风险结构优化的过程中不断提高基金的收益水平。

6、投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例、组合基准久期、回购的最高比例等重大投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向集中交易室下达投资指令。

集中交易室设立债券交易员，负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。集中交易室同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

7、投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

（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具体的资产分布比例、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、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。

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低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,979,913,045.00	83.58
	其中：债券	1,979,913,045.00	83.58
	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	310,300,000.00	13.10
	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	38,409,905.08	1.62
7	其他资产	40,391,943.18	1.71
8	合计	2,369,014,893.26	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	180,313,000.00	7.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,445,000.00	2.15
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,195,800,233.60	50.87
5	企业短期融资券	501,003,000.00	21.31
6	中期票据	29,922,000.00	1.27
7	可转债（可交换债）	22,429,811.40	0.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,979,913,045.00	84.23

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	150024	15附息国债24	800,000	80,136,000.00	3.41
2	160001	16附息国债01	700,000	70,126,000.00	2.98
3	011699062	16陕延油SCP001	700,000	69,958,000.00	2.98
4	041672001	16鲁高速CP001	700,000	69,902,000.00	2.97
5	136143	16万达01	690,000	69,317,400.00	2.95
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				
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				
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

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。
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

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。
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。
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在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	1,166.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,038,763.88
5	应收申购款	3,352,012.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,391,943.18

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	128009	歌尔转债	2,534,400.00	0.11

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。
（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、富国天丰强化收益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

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
2008.10.24-2008.12.31	4.20%	0.19%	3.36%	0.16%	0.84%	0.03%
2009.1.1-2009.12.31	7.23%	0.15%	-0.32%	0.07%	7.55%	0.08%
2010.1.1-2010.12.31	16.27%	0.18%	2.05%	0.07%	14.22%	0.11%
2011.1.1-2011.12.31	-0.32%	0.15%	5.33%	0.08%	-5.65%	0.07%
2012.1.1-2012.12.31	7.86%	0.15%	3.60%	0.06%	4.26%	0.09%
2013.1.1-2013.12.31	-2.25%	0.20%	-0.47%	0.09%	-1.78%	0.11%
2014.1.1-2014.12.31	13.09%	0.19%	10.34%	0.11%	2.75%	0.08%
2015.1.1-2015.12.31	18.53%	0.49%	8.15%	0.08%	10.38%	0.41%
2016.1.1-2016.3.31	0.73%	0.06%	1.14%	0.07%	-0.41%	-0.01%
2008.10.24-2016.3.31	84.34%	0.24%	37.83%	0.09%	46.51%	0.15%

2、自基金合同生效以来富国天丰强化收益债券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

注：截止日期为2016年3月31日。
本基金合同生效日为2008年10月24日，建仓期6个月，即从2008年10月24日起至2009年4月23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、与基金运作有关费用列示
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金财产拨划支付的银行费用；
（4）基金合同生效后的基金信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
（7）基金的证券交易费用；
（8）在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
（9）依法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规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规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0.6%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年管理费率÷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，支付日期顺延。
（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0.2%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年托管费率÷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，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）除管理费和托管费之外的基金费用，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
1、申购费用
本基金提供两种申购费用的支付模式。投资人可以选择前端收费模式，即在申购时支付申购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的申购费用，该费用随基金份额的持有时间递减。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、登记结算等各项费用。
（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。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。在前端申购时，本基金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。具体费率如下：
A、申购费率

申购金额（含申购费）	前端申购费率
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

注：上述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投资者。
B、特定申购费率

申购金额（M，含申购费）	特定申购费率%
M<100万	0.24
100万≤M<500万	0.15
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、选择前端收费模式申购本基金的养老金客户，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以及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）	1.0%
1年—3年（含）	0.6%
3年—5年（含）	0.4%
5年以上	0

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。
2、赎回费用
赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的25%归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。
本基金的场内赎回适用固定的赎回费率，定为0.1%。
本基金的场外赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

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

其中，在场外认购以及本基金转为上市开放式基金(LOF)之后场外申购的投资者其份额持有年限以份额实际持有年限为准；在场内认购、场内申购以及场内买入，并转托管至场外赎回的投资者其份额持有年限自份额转托管至场外之日起开始计算。
基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
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。
直销网上交易系统和电话委托系统对使用除招商银行借记卡直接支付方式外的前端基金转换费的补差费实施4折费率优惠，对使用招商银行借记卡直接支付方式的前端基金转换费的补差费实施8折费率优惠。
（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。
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。
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。本公司中登基金的转换只能在直销渠道进行。
（3）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。详见本公司2013年2月7日公告《富国基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告》。
（三）其他费用
本基金其他费用根据相关法律法规执行。

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、主要成员情况等内容进行了更新。
3、对"四、基金托管人"部分内容进行了更新。
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、"九、基金份额的申购与赎回"对代销机构信息进行了更新。
6、"十一、基金的投资"部分，本基金投资组合报告内容更新至2016年3月31日。
7、"十二、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。
8、"二十、风险揭示"部分在声明中对本基金的代销机构进行了更新。
9、对"二十四、基金份额持有人服务"部分内容进行了更新。
10、"二十五、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
二〇一六年五月三十一日

股票代码：601028　股票简称：玉龙股份　编号：2016-027

江苏玉龙钢管股份有限公司关于签订合同的公告

本公司董事会及全体董事保证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：
●合同类型及金额：直缝埋弧焊接钢管销售合同，合同总金额约为1.37亿元。
●合同生效条件：合同自双方签字盖章之日起生效。
●合同履行期限：合同签订生效后，由卖方负责按合同中约定期限将相对应产品一次性交付给卖方。
●对上市公司当期业绩的影响：本次合同履行将对提升公司2016年度业绩产生积极影响，不构成重大影响。

一、合同标的和对方当事人情况
（一）合同标的的情况
近日，江苏玉龙钢管股份有限公司（以下简称"玉龙股份"或"公司"）与山东科瑞石油装备有限公司（以下简称"山东科瑞"）签订了焊管买卖合同，公司拟向山东科瑞出售总计约为3.8万吨的直缝埋弧焊接钢管产品，金额合计约为1.37亿元。
（二）合同对方当事人情况
企业名称：山东科瑞石油装备有限公司
企业性质：有限责任公司
注册地及主要办公地点：山东省东营市南二路233号
法定代表人：杨宪
注册资本：36,200万元人民币
主营业务：石油机械设备、机电设备（不含专控）生产、销售；电机、
发电机组、汽车（不含小轿车）、石油测控设备、仪器仪表、钢材、化工产品（不含危险品）、石油助剂（不含危险品）、泵、锅炉、常压电器、压缩机、污水处理设备销售；石油地面工程；污水处理技术服务；石油新技术开发及服务；网络工程（不含互联网）；货物进出口业务；石油钻采装备及配套设备（石油钻机、采油机械设备、空分设备、油气工艺设备、井口设备）制造、销售；石油技术服务；燃料油（闪点>61℃）销售（无储存）；石油机械设备租赁。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)
主要股东及实际控制人：山东科瑞控股集团有限公司
山东科瑞与公司及公司控股子公司之间不存在产权、业务、资产、债权债务、人员等方面的关联关系。
山东科瑞和公司有着多年合作基础，2013、2014及2015年公司向山东科瑞销售产品金额合计约为6.3亿元，分别占当年营业收入的15.21%、6.13%、2.43%。
二、合同的主要条款
1、合同双方
卖方：江苏玉龙钢管股份有限公司
买方：山东科瑞石油装备有限公司
2、合同标的：直缝埋弧焊接钢管
3、合同金额：1.37亿元
4、结算方式：合同生效后，买方将根据卖方提供的排产计划和原材料采购合同按比例划付一定的货款，待货物运至上海港买方指定地点后五个工作日内付清剩余货款。
5、供货期限：合同签订生效后，由卖方负责按合同中约定期限将相对应产品一次性交付给卖方。
6、合同生效条件：合同自双方签字盖章之日起生效。
三、合同履行对公司的影响
1、上述合同总金额占本公司2015年度经审计总资产的4.20%，占本公司2015年度经审计营业收入的6.15%。本合同的履行将对公司未来业绩产生积极影响。
2、本合同约定的产品与公司主营业务一致，合同的履行有利于公司经营目标的实现，提高公司持续经营能力。
3、本公司与山东科瑞不存在关联关系，本次合同不会影响公司业务的独立性。
四、风险提示
1、交易对方和公司有着多年合作基础，经营规模较大，信用较好，双方均具有较好履约能力。
2、本次中标的直缝埋弧焊接钢管为公司技术成熟产品，但产品涉及出口，公司将采取一切必要举措，做好各项风险控制措施。
3、合同在履行过程中如果遇到不可预计的或不可抗力等因素的影响，有可能会导致合同无法全部履行或终止的风险。
敬请广大投资者谨慎决策，注意防范投资风险。
五、备查文件
1、《买卖合同》
2、《补充协议》
特此公告！

江苏玉龙钢管股份有限公司
2016年5月31日

证券代码：600379　证券简称：宝光股份　编号：2016-33

陕西宝光真空电器股份有限公司重大资产重组进展公告

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。

陕西宝光真空电器股份有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）因大股东北京融昌航投资咨询有限公司筹划涉及本公司的重大资产重组事项，本公司股票自2015年11月25日起停牌，2015年12月2日本公司发布了《重大资产重组停牌公告》，申请本公司股票自2015年12月2日起停牌一个月。后经公司申请，公司股票分别自2016年1月4日、2月4日起继续停牌一个月。2016年3月3日，本公司发布了《重大资产重组进展暨股票继续停牌的公告》，公司申请将最晚于2016年3月14日前披露重组预案。停牌期间，本公司每5个交易日发布一次重大资产重组进展公告。
2016年3月12日，公司召开了第五届董事会第四十四次会议和第五届监事会第二十次会议，会议审议通过了《关于<陕西宝光真空电器股份有限公司重大资产购买及重大资产出售暨关联交易预案>及其摘要的议案》等相关议案和文件，并于2016年3月14日在公司指定信息披露媒体《中国证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn）刊登了相关公告。根据相关监管要求，上海证券交易所需对公司本次重大资产重组预案及相关文件进行事后审核，公司股票自2016年3月14日起继续停牌。
2016年3月21日，公司收到了上海证券交易所《关于对陕西宝光真空电器股份有限公司重大资产购买及重大资产出售暨关联交易预案信息披露的问询函》（上证公函【2016】0263号）（以下简称《问询函》）。根据问询函要求，公司积极组织有关各方及中介机构对《问询函》中所列问题进行了逐项落实和回复，2016年3月31日公司披露了《陕西宝光真空电器股份有限公司关于上海证券交易所<关于对陕西宝光真空电器股份有限公司重大资产购买及重大资产出售暨关联交易预案信息披露的问询函>的回复公告》、修订后的重组预案及其摘要等相关文件。
根据相关规定，经向上海证券交易所申请，公司股票已于2016年3月31日起复牌。现将公司重大资产重组进展情况公告如下：
一、重大资产重组及国有股转让事项的进展情况
自本次重大资产重组预案披露以来，公司及相关各方积极推进本次重大资产重组工作。截至目前，本次重大资产重组所涉及方案细化、资产审计、评估及其他核查工作等正在紧张有序的开展之中。待相关工作完成后，公司将再次召开董事会审议本次重大资产重组的相关事项，披露本次重大资产重组报告书(草案)等相关文件，并按照相关法律法规履行后续审批及信息披露程序。
本次国有股转让事项已初步确定了意向受让方（具体内容详见公司发布的2016-28号公告）。经向国有股东了解获悉：截止目前，鉴于本次国有股转让意向受让方之一北京融昌航投资咨询有限公司正在对其所持上市公司股权被轮候冻结事项妥善解决之中，国有股东暂未与各受让方签署完成《股份转让协议》。待上述问题解决后，相关各方将及时签署完毕相关协议并推进本次国有股转让的各项后续工作。
二、特别提示
（一）根据《上市公司重大资产重组管理办法》及上海证券交易所发布的《上市公司重大资产重组信息披露及停复牌业务指引》的有关规定，公司将根据本次重大资产重组进展情况及时履行信息披露义务，在发出股东大会召开通知前，每月发布一次重大资产重组进展公告。
（二）截至本公告日，除本次重大资产重组预案披露的风险因素之外，未发现存在可能导致公司董事会或者交易对方撤销、终止本次重组方案或者对本次重组方案做出实质性重大变更的相关事项。
（三）公司于2016年3月31日披露的《陕西宝光真空电器股份有限公司重大资产购买及重大资产出售暨关联交易预案（修订稿）》中对本次重大资产重组可能涉及的有关重大风险因素及尚需履行的审批程序进行了特别说明，提请投资者真阅读有关内容。
公司指定信息披露网站、媒体为《中国证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)，公司将根据重大资产重组进展情况及时履行信息披露义务，敬请广大投资者关注后续公告，注意投资风险。
特此公告。

陕西宝光真空电器股份有限公司董事会
2016年5月31日

证券代码：002667　证券简称：鞍重股份　公告编号：2016-035

鞍山重型矿山机器股份有限公司关于浙江九好收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告

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

鞍山重型矿山机器股份有限公司（以下简称"鞍重股份"）于2016年5月28日收到浙江九好办公服务集团有限公司（以下简称"浙江