关于召开华商中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的公告

(上接B17版)

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是:

沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%

本基金为混合型证券投资基金,股票投资比例为0-95%,因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为65%,其余为债券投资部分。

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑:

1、沪深300指数编制合理、透明、运用广泛,具有较强的代表性和权威性。

2、上证国债指数以国债为样本,按照发行量加权而成,具有良好的债券市场代表性。

3、作为混合型基金,选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

如果今后上述基准指数停止计算编制或更改名称,或法律法规发生变化,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,或市场中出现更适用于本基金的比较基准指数,本基金可以在征得基金托管人同意后报中国证监会备案后变更业绩比较基准,并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

六、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高预期风险和中高预期收益产品。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值;

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益;

4、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理。

八、基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

22、修改《基金合同》第十五部分 基金资产估值 "三、估值对象,四、估值程序,五、估值方法"

原有表述为:

三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

四、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以约定形式报给基金托管人,基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核,基金托管人复核无误后返回给基金管理人,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

五、估值方法

本基金按以下方式进行估值:

1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4. 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

6. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

拟修改为:

二、估值对象

基金所拥有的股票、股指期货合约、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

5、中小企业私募债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

6、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

7、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按约定对外公布。

23、修改《基金合同》第十七部分 基金的费用与税收

原有表述为:

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金上市费和上市年费;

9、基金的指数使用费;

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。

本基金终止清算时所发生费用,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

在分级运作期内,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。分级运作期届满后,本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×年管理费÷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2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、公休假等,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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×年托管费÷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2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、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许可使用费计提方法每日计提指数许可使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.02%÷当年天数

H为每日计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

支付方式为:每季支付一次

如基金管理人与标的指数许可方的指数使用许可协议约定的收费标准、支付方式等发生变更,按照变更后的费率、支付方式执行。

上述一、基金费用的种类中第3—8项及第10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,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;

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

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,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前2日在至少一种指定媒体上公告。

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。

拟修改为:

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券、期货交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的开户费用、账户维护费用

9、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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,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首日起2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、公休假等,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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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,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首日起2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。

上述"一、基金费用的种类中第3—9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、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。

五、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

24、修改《基金合同》第十八部分 基金的收益与分配

原有表述为:

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

三、基金收益分配原则

(一)在分级运作期内,本基金所有份额(包括华商中证500份额、华商中证500A类份额、华商中证500B类份额)不进行收益分配。

(二)本基金分级运作期届满并转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金收益分配应遵循下列原则:

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、登记在注册登记系统的基金份额,其收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(具体日期以本基金分红公告为准);若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红; 登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式为现金分红,投资人不能选择其他的分红方式,具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国登记结算有限责任公司的相关规定;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额(具体日期以本基金分红公告为准);

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。

六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

拟修改为:

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金份额持有人选择采取红利再投资形式的,分红资金将按除权日的基金份额净值转成基金份额,红利再投资的份额免收申购费;同一投资人持有的基金份额只能选择一种分红方式,如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同,登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准;

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

25、删除《基金合同》第十九部分 基金份额的折算。

26、基金销售费用

《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效后,本基金的申购费率、赎回费率与转型前华商中证500指数分级证券投资基金的申购费率、赎回费率相同。本基金转型前华商中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人的基金份额持有期限将计入其持有本基金的基金份额的持有期限。

27、授权基金管理人修订《基金合同》

除上述内容的调整需要修改《基金合同》以外,考虑到自《基金合同》生效以来,《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规陆续修订或制定施行,基金管理人需要依据最新法律法规修订《基金合同》相关内容。

同时,由于基金投资范围和基金类别等发生变更,基金名称将变更为"华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金",《华商中证500指数分级证券投资基金基金合同》将变更为《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

综上所述, 基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及转型后的华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的产品特性相应修订《基金合同》的内容。

三、基金转型方案

1、基金份额的折算

自基金份额持有人大会决议生效并公告后,基金管理人将对本基金进行份额折算,基金份额折算方案如下:

(1)折算前基金份额净值的计算

1)折算前华商中证500份额净值的计算

折算前华商中证500份额净值=折算基准日的华商中证500指数分级证券投资基金资产净值/折算前华商中证500指数分级证券投资基金份额的余额数量。

其中,基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值,折算前华商中证500指数分级证券投资基金份额的余额数量为折算前华商中证500份额、华商中证500A份额与华商中证500B份额的份额总额。

2)折算前华商中证500A和华商中证500B份额的基金份额净值计算

定义如下:

Tc为华商中证500A份额应计收益天数

NAV为折算前华商中证500份额净值

NAVa为折算前华商中证500A份额净值

NAVb为折算前华商中证500B分额净值

R为华商中证500A份额运作当年的约定年收益率

Tt为完整分级运作期内的实际总天数

NAVa=1+3★R★Tc/Tt

NAVb=(10★NAV-4★NAVa)/6

其中Tc=min(基金合同生效日至当前折算日,最近一次份额折算日至当前折算日)

折算前基金份额净值的计算保留到小数点后8位,小数点后第9位四舍五入,由此产生的计算误差归入基金资产,并由基金管理人通知基金托管人对账务进行调整。

(2)基金份额折算公式

折算前华商中证500A份额首先折算为华商中证500份额,新增加的华商中证500份额为:

华商中证500A份额折算为华商中证500份额的份额数=华商中证500A份额净值★华商中证500A份额余额数量/折算前华商中证500份额净值。

折算前华商中证500B份额首先折算为华商中证500份额,新增加的华商中证500份额为:

华商中证500B份额折算为华商中证500份额的份额数=华商中证500B份额净值★华商中证500B份额余额数量/华商中证500份额净值。

在华商中证500A份额与华商中证500B份额折算为华商中证500份额后, 华商中证500份额统一转换为华商新趋势优选基金份额。折算后华商中证500A份额与华商中证500B份额将不再在深圳证券交易所挂牌交易。

折算后华商新趋势优选基金份额的份额数=折算基准日登记在册的华商中证500基金份额的份额数

折算后华商新趋势优选基金基金份额的份额数,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的计算误差归入基金资产。

(3)基金份额折算结果的公告

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

3、暂停申购、赎回、上市交易等业务

为确保华商中证500指数分级证券投资基金转型期间严格执行《基金合同》的相关规定,从而保证转型前后各基金份额持有人的利益,华商中证500指数分级证券投资基金于持有人大会决议通过之日起暂停日常申购(含定期定额投资)、赎回、转换(含转出、转入)、上市交易等业务,并在《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日起不超过三个月内开放日常申购(含定期定额投资)、赎回、转换(含转出、转入)、上市交易业务,基金管理人将在申购开放日前按照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上公告。

4、基金份额持有人的赎回

华商中证500基金的场外基金份额持有人可在开放日进行日常的赎回;

在《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效之前,华商中证500基金的场内基金份额持有人需提交跨市场转托管或赎回申请进行份额的赎回。未提交跨市场转托管或者赎回申请的场内份额持有人所持有的基金份额仍然保留在投资者资金账户中。在本基金转型生效之后,持有人需要赎回场内份额时,将自行进行场外开户和跨市场转托管,华商基金管理有限公司不再对此进行公告。

5、《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效

自华商中证500指数分级证券投资基金基金份额折算日 (指华商中证500指数分级基金转换为华商新趋势优选基金份额之日)的次日起,《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,《华商中证500指数分级证券投资基金基金合同》同时失效,华商中证500指数分级证券投资基金正式转型为华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金,本基金基金合同当事人将按照《华商新趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

四、基金转型的可行性

(一)投资方面

基金管理人已对基金转型后的运作进行了充分的分析,转型后本基金将秉承灵活配置混合型基金投资理念,鉴于我司有丰富的混合型基金运作经验,投资方面具有较好的可行性。

(二)法律方面

《基金合同》约定,基金转型需召开基金份额持有人大会,根据《基金合同》,本次基金份额持有人大会决议属于一般决议,经参加大会的基金份额(指华商中证500份额、中证500A份额、中证500B份额各自基金份额)持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过即为有效,基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

五、基金转型的主要风险及预备措施

(一)转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前,我司已对持有人进行了走访,认真听取了持有人意见,拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后,我们还将再次征询意见。如有必要,基金管理人将根据持有人意见,对转型方案进行适当的修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下,预留出足够的时间,以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得基金份额持有人大会批准, 基金管理人计划按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交转型方案议案。

(二)基金转型前后的运作风险

本基金转型前后,为保护基金持有人利益,拟采取如下措施:

1、调整投资范围和投资组合限制,以符合灵活配置混合型基金的要求。

2、持有流动性好,波动性较小的证券,以降低由于基金转型而可能带来的市场申购或赎回压力。

特此说明。

华商基金管理有限公司
2015年1月26日

附件三:

华商中证500指数分级证券投资基金
基金份额持有人大会(通讯方式)表决票效力认定程序和标准

一、由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。

二、表决票应于2015年3月9日17:00前通过专人或邮寄方式送达至:

北京市西城区西环广场11层1113室,邮编100044

北京市方正公证处 王顺心

请在信封表面注明:"华商中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会投票专用"

送达时间以北京市方正公证处收到表决票的时间为准,逾时送达的表决票即为无效,不视为已参与本次基金份额持有人大会表决,亦不计入参与本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数之内。

三、基金份额持有人重复寄送表决票者,若各表决票之意思相同时,则视为同一表决票;表决之意思相异时,按如下原则处理:

1、送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

2、送达时间为同一天的,视为在同一表决票上作出了不同表决意见,视为弃权表决,计入有效表决票。

送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以本公告列明的公证机构收到的时间为准。

四、如表决票有下列情形之一者,该表决票无效,并且不视为该基金份额持有人已参与本次基金份额持有人大会表决,亦不计入参与本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数之内。

1、机构投资者的表决票未附加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件),以及未在表决票上加盖公章的;合格境外机构投资者未在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),以及未提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件、该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件、该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件或取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

2、个人投资者未在表决票上签字及未附本人有效身份证件正反面复印件的;

3、通过委托代理人表决的,未同时提供代理人的有效身份证件正反面复印件(代理人为个人)或未附加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)(代理人为机构)或未填妥授权委托书的。

4、表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的;

5、未能在截止时间之前送达指定地址的。

五、如表决票有下列情形之一但其他要素符合会议通知规定者,该表决意见视为弃权,计入有效表决票;并按"弃权"计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数:

1、对同一议案表决超过一项意见或未表示意见的;

2、表决票"表决意见"一栏有涂改的、模糊不清或矛盾的;

3、表决票污染或破损,并且无法辨认其表决意见的。

附件四:

华商中证500指数分级证券投资基金
基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人基本资料		
1	基金份额持有人姓名或名称:	
2	基金份额基金账户号: (如有多个请逐一填写)	
3	基金份额持有人身份证件类型及号码:(个人投资者填写)	
4	基金份额持有人营业执照类型及号码:(机构投资者填写)	
如基金份额持有人委托他人代为投票,请填写		
5	代理人姓名或名称:	
6	代理人身份证件类型及号码: (如代理人为个人)	
7	代理人营业执照类型及号码: (如代理人为机构)	
表决意见:《关于修改华商中证500指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》(请在意见栏右方划"√")		
8	同意	
	反对	
	弃权	
签字或盖章		
9	基金份额持有人/代理人签字或盖章: 年 月 日	

(本表决票可剪报、复印或按以上格式自制,在填写完整并签字盖章后均为有效)

关于表决票的填写说明:

请以打"√"方式在表格对应位置注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额(包括各类别份额)的表决意见。表决意见效力的认定规则请详细阅读本次大会公告附件三。

附件五:

授权委托书

本人(或本机构)持有或申购了华商中证500指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")的基金份额,就《关于召开华商中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项,本人(或本机构)的意见为(请在意见栏下方划"√"):

同意	反对	弃权

本人(或本机构)特此授权____________________代表本人(或本机构)以通讯方式出席华商中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会,并按照上述意见代为行使表决权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人(签字/盖章):

委托人身份证件号或营业执照号:

委托人基金账户号:

受托人(签字/盖章):

受托人身份证件号或营业执照号:

签署日期: 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1. 本授权委托书(样本)可剪报、复印或按以上格式自制,在填写完整并签字或盖章后均为有效。

2. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。如基金份额持有人一次授权多个受托人或多次授权的,能够区分先后次序的,以最后一次授权为准;授权无法区分授权次序,且授权意见不一致的,视为委托人授权基金管理人选择其中一种授权表示行使表决权。

3. 如委托人未在授权委托书表示中明确其表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权;如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

4. 本授权委托书(样本)中"委托人证件号码",指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5.授权委托书中委托人所持基金的份额以持有人大会权益登记日为准。如本次持有人大会权益登记日,投资者不再持有本基金的基金份额,则其授权委托书自动失效。

(上接B18版)

联系电话: 0371-68599287联系传真:0371-65585665
网址:www.ccnew.com

(80)西南证券股份有限公司
地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
客服电话:4008096096
联系人:徐雅筠、杨再巧
网址:www.swsc.com.cn

(81) 山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
客服电话:0351-8686868
联系人:张治国
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
网址:www.i618.com.cn

(82) 第一创业证券有限责任公司
地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25F
法人代表:刘学民
电话:4008881888
网址:www.firstcapital.com.cn

(83) 民生证券股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人:余政
客服电话:4006198888
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
联系传真:010-85127917
公司网址:www.mszq.com

(84) 东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州市石路爱河桥路28号
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:方晓丹
客户服务电话:0512-96288
网址: http://www.dwzq.com.cn

(85) 金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层(邮政编码:570206)
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼(邮政编码:518034)
法定代表人:陆涛
客服电话:4008-888-228
联系人:金春
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
网址:www.jyzq.cn

(86) 南京证券有限责任公司
住所:南京市大钟亭8 号
法定代表人:张华东
客服电话:025-83367888
联系人:石健
电话:025-83367888
传真:025-83364032
网址:www.njzq.com.cn

(87) 德邦证券有限责任公司
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建大厦26楼(邮政编码:200122)
法定代表人:王军
客服电话:021-68761616-8125
电话:021-68761616
传真:021-68767981
网址:www.tebon.com.cn

(88)天源证券经纪有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
统一客服电话:4006543218
公司网站地址:www.tyzq.com.cn

(89)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号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:翟璟
联系电话:(027)87618882/(028) 86711410
传真:(027)87618863
公司网站:www.tfzq.com

(90)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:曾小普
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6282293
网址:www.gsstock.com

(91)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
联系人:陈敏
网站:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918

(92) 中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
客服电话:400-1022-011
网址:www.zszq.com.cn

(93)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:万建华
客服电话:95521
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670161
网址:www.gtja.com

(94) 中信建投股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权唐
电话:010-85130577
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com

(95)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:黄恒
联系电话:010-58568062
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
网址:www.hrsec.com.cn

(96)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:常春艳
联系电话:0755-82721122
传真:0755-82029055
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com

(97)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
法人代表:陈柏青
联系人:张裕
电话:0571-2882935
传真:0571-26698533
客户服务电话:4000-766-123
网址: www.fund123.cn

(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
联系人:刘玉生
电话:010-66213961
传真:010-59378907

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:靳庆军、冯艾
联系人:冯艾

(四)会计师事务所和经办注册会计师
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)
注册地址: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:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
经办注册会计师:薛竞、叶尔甸
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:刘莉

四、基金的名称

大成景阳领先股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资目标

追求基金资产长期增值。

八、基金的投资方向

限于国内依法发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中,权证投资比例范围为基金资产净值的0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-40%,其中,资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的0-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的比例最低为基金资产净值的5%。

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。

九、基金的投资策略

1. 投资理念

在中国经济强劲增长、企业盈利持续上升以及人民币稳定升值的背景下,形成了一批代表我国新兴经济体特点、具有核心竞争力的领先上市公司。本基金将通过定量与定性分析相结合的方式,选择此类上市公司进行投资,分享中国经济高速成长果实,获取超额收益。

2. 大类资产配置

本基金将在基金合同允许的范围内,根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平,阶段性不断调整股票资产和其他资产之间的大类资产配置比例。其中,全球主要股市的市盈率比较、我国GDP增速、上市公司总体盈利增长速度、股市和债市的预期收益率比较以及利率水平,是确定大类资产配置比例的主要因素。

3. 股票投资策略

(1)建立初选股票池

本基金通过建立初选股票池,避免投资于具有较大风险的股票。

企业的历史财务表现不但能刻画企业的经营情况、财务健康程度,还可以较大程度上反映其未来成长性。本基金将通过对上市公司过去3年主营业务收入增长率、主营业务利润率、净资产收益率和净利润增长率等财务指标的分析,选择上述财务指标优于行业平均水平的上市公司,建立基金初选股票池。

(2)建立备选股票池

能够充分从中国经济高速成长中获益的领先上市公司,是本基金的主要投资对象。基金投资团队将在初选股票池的基础上,选择具有以下一项或多项特征的上市公司构建备选股票池。

①高速增长行业中市场份额领先的龙头上市公司

随着中国经济的快速发展和人民富裕程度的不断提高,与消费升级、金融深化和产业结构调整相关的行业及其上游行业将从中充分获益,并持续保持较高的增长速度,而此类行业中市场份额领先的龙头上市公司将是行业发展中的主要受益者。因此,过去2年其所在行业销售额增长速度高于GDP增速,且过去3年在全行业市场占有率居于前列的上市公司,本基金将予以关注。

②资源优势领先的上市公司

长期来看,中国仍将作为制造业大国参与国际竞争,对自然资源将保持较大需求。由于自然资源的稀缺性和不可再生性,对自然资源的开发、销售等具有垄断优势的上市公司将会长期获益。

③在获益于人民币升值方面具有领先优势的上市公司

伴随着中国经济的高速增长,人民币升值是一个长期趋势,将导致消费需求变化和产业结构调整,直接带动相关行业和上市公司的业绩增长。

④外延扩张能力领先的上市公司

作为全球最重要的新兴经济体,中国将越来越多的参与到国际竞争中来。在此过程中,重组和购并将是我国上市公司增强国际竞争力的重要方式和手段,也有助于显著提升其未来盈利能力。因此,有明确重组、购并计划或潜在机会,且重组、购并将显著提升上市公司盈利能力、市场占有率或产能水平,并将在未来1-2年内实施或实现的上市公司也将进入基金的备选股票池。

(3)实地调研

基金投资团队将在案头分析的基础上、通过公司实地调研等方式,深入了解备选股票池成份股基本面数据的真实性,确保对上市公司内在价值估计的合理性。基金投资团队将把上市公司的盈利能力与国际、国内同行业的公司作比较,调研与公司有关的供应商、客户、竞争对手等各方的情况,通过行业主管机关、税务部门、海关等机构进行第三方数据核实。

(4)估值比较

结合实地调研的结果,本基金将根据备选股票池中上市公司所处行业、业务模式等特征,综合利用市盈率(P/E)、市净率(P/B)和折现现金流(DCF)等估值方法,通过估值比较对备选股票池成份股做进一步筛选。估值比较将主要从两方面对投资价值进行分析:一是上市公司在其所处行业内部的相对估值水平;二是与境外类似上市公司的估值水平差异,特别是与香港市场上市公司的差异。

(5)建立和调整投资组合

本基金将在实地调研和案头分析的基础上,按照估值比较的排序结果,选择估值比较结果最优的上市公司,建立买入股票名单,并选择合理时机,稳步建立投资组合。在建立投资组合过程中,本基金还将注重投资对象的交易活跃程度,以保证整体组合具有良好的流动性。

投资组合建立后,基金投资团队将动态跟踪上市公司的基本面变化,动态调整投资组合,使其保持较好的安全性、流动性和增值潜力。

4. 债券投资策略

本基金将在严格控制组合风险的前提下,进行总体的战略资产配置。同时,基于收益的要求,在战术资产配置、类属配置、个券选择和交易执行层面上实施积极的策略,以期在承担有限风险的前提下获得较高的投资收益。战术资产配置上,本基金将通过深入分析宏观经济、政策影响和市场信用利差结构等各种变量并参照市场基准久期,确定出目标久期。类属配置上,将通过各类属资产的比例配置、期限配置以及市场配置实现超额收益。个券选择和多样化的交易策略将成为本基金日常获取超额收益的重要手段。

5. 其他投资策略

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下,对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面:1)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;2)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;3)利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。

本基金还将在基金合同规定的投资范围内,依法投资于其他金融工具,用于基金的风险管理和增加收益。

十、基金的业绩比较基准

80%×沪深300指数+20%×中信标普全债指数

十一、基金的风险收益特征

本基金是股票型基金,风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。

十二、基金的投资组合报告(截至2014年9月30日)

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定,于2014年12 月24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2014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	1,581,905,458.20	83.08
	其中:股票	1,581,905,458.20	83.08
2	固定收益投资	90,207,000.00	4.74
	其中:债券	90,207,000.00	4.74
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	193,410,386.29	10.16
7	其他资产	38,605,117.54	2.03
8	合计	1,904,127,962.03	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	21,729,361.32	1.15
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	1,092,931,323.47	57.61
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	4,542,000.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	366,141,168.67	19.30
J	金融业	39,000,000.00	2.06
K	房地产业	9.18	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	57,561,595.56	3.03
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	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	1,581,905,458.20	83.38

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	300273	和佳股份	5,800,000	132,646,000.00	6.99
2	600887	伊利股份	5,004,923	129,627,505.70	6.83
3	000651	格力电器	4,000,062	110,921,719.26	5.85
4	300147	香雪制药	3,900,000	88,491,000.00	4.66
5	000503	海虹控股	3,999,784	86,075,351.68	4.54
6	002433	太安堂	6,005,612	78,613,461.08	4.14
7	002153	石基信息	1,000,000	70,170,000.00	3.70
8	000625	长安汽车	5,000,125	68,501,712.50	3.61
9	600645	中源协和	1,599,822	57,561,595.56	3.03
10	000733	振华科技	3,005,660	56,506,408.00	2.98

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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	90,207,000.00	4.75
	其中:政策性金融债	90,207,000.00	4.75
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	90,207,000.00	4.75

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	140429	14农发29	900,000	90,207,000.00	4.75

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

报告期末本基金未持有资产支持证券投资。

7. 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贵金属投资明细

报告期末本基金未持有贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证投资。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

(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)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。

(2)本基金在报告期内投资的前十名股票中,没有投资超出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	429,040.12
2	应收证券清算款	36,046,899.91
3	应收股利	-
4	应收利息	2,086,927.94
5	应收申购款	42,249.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,605,117.54

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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不存在流通受限情况的说明

(6)由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

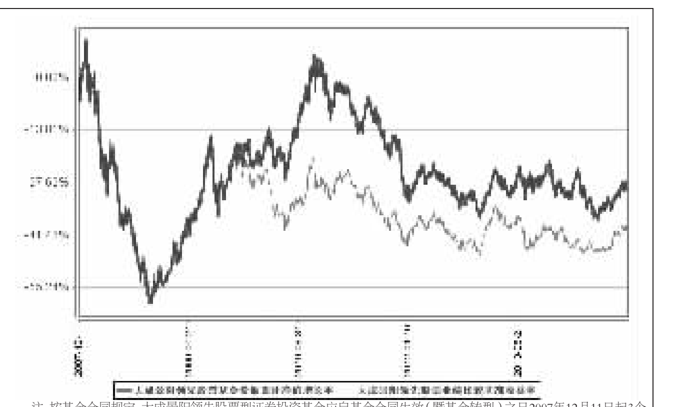
十三、基金业绩

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)自基金合同生效以来(2007年12月11日)至2014年9月30日基金份额净值增长率及其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
2007.12.11-2007.12.31	2.08%	1.61%	3.30%	1.38%	-1.22%	0.23%
2008.1.1-2008.12.31	-57.17%	2.26%	-56.15%	2.44%	-1.02%	-0.18%
2009.1.1-2009.12.31	81.28%	1.87%	73.37%	1.65%	7.91%	0.22%
2010.1.1-2010.12.31	20.40%	1.36%	-9.34%	1.27%	29.74%	0.09%
2011.1.1-2011.12.31	-29.07%	1.13%	-19.71%	1.04%	-9.36%	0.09%
2012.01.01-2012.12.31	-1.42%	1.08%	7.18%	1.02%	-8.60%	0.06%
2013.01.01-2013.12.31	-0.16%	1.25%	-5.49%	1.12%	5.33%	0.13%
2014.01.01-2014.09.30	5.14%	1.07%	5.42%	0.80%	-0.28%	0.27%
2007.12.11-2014.09.30	-29.96%	1.52%	-38.97%	1.45%	9.01%	0.07%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,大成景阳领先股票型证券投资基金应自基金合同生效(暨基金转型)之日2007年12月11日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末,本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项投资比例。

十四、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)证券交易费用;

(4)基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金的资金汇划费用;

(7)按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以从基金资产中列支的其他费用。

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

在通常情况下,该项费用按前一日的基金资产净值1.5%的年费率计提,即本基金的年管理费率为1.5%。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

管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。基金托管人应于次月首日起10个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支付。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,该项费用按前一日的基金资产净值0.25%的年费率计提,即本基金的年托管费率为0.25%。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。基金托管人应于次月首日起10个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支付。

(3)上述"1、基金费用的种类"第(3)至(7)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,由基金托管人从基金财产中支付。

(二)与基金销售相关费用

1. 申购费用

集中申购期申购费率与日常申购费率一致,本基金日常申购费率如下:

申购金额M	费率
M<50万	1.50%
50万≤M<200万	1.00%
200万≤M<500万	0.60%
M≥500万	1000元/笔

投资者多次申购,须按每次申购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例确认方式对有效申购金额进行部分确认时,投资者申购费率按照申购申请确认金额所对应的费率计算。

本基金申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,在投资者申购基金份额时缴纳,用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

基金申购份额的计算:

净申购金额=申购金额÷(1+申购费率)

(注:申购金额在500万元(含)以上适用绝对数额的申购费金额,即净申购金额=申购金额-申购费用)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额÷T日基金份额净值

对于办理场内申购的投资者,申购份数的计算采用截尾法保留至整数位,不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者;对于办理场外申购的投资者,申购份数的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位。由此误差产生的损失或收益归入基金财产。

2. 赎回费用

本基金赎回费率如下:

持有期限	费率
1年以内(不含1年)	0.50%
1年到2年(不含2年)	0.25%
2年(含2年)以上	0

投资者在基金终止上市前持有的原景阳基金份额,持有期限自《大成景阳领先股票型证券投资基金基金合同》生效之日起计算;投资者通过集中申购和日常申购所得的基金份额,持有期限自注册登记机构确认登记之日起计算。本基金赎回费的25%归入基金财产,其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。

基金净赎回金额的计算:

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

计算结果以四舍五入的方法保留小数点后2位。由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

3. 基金份额净值的计算:

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告。计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

4. 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。

5. 费率的调整

基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率和基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率和基金托管费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式,无须召开基金份额持有人大会。

将来法律法规许可的情况下,本基金可以依法提取业绩报酬和/或业绩风险准备金。

基金管理人最迟应于新的费率或收费模式实施前2日在至少一种指定媒体上予以公告,并报中国证监会备案。

(三)基金税收

本基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。

十五、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及基金合同的规定,对2014年7月25日公布的《大成景阳领先股票型证券投资基金更新的招募说明书(2014年第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"九、基金的投资"部分。
5. 根据最新数据,更新了"十、基金业绩"部分。
6. 根据最新情况,更新了"二十二、对基金份额持有人的服务"部分。
7. 根据最新情况,更新了"二十三、其他应披露的事项"。
8. 根据最新情况,更新了"二十四、对招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司
二〇一五年一月二十六日