# 中银聚利分级债券型证券投资基金之聚利B份额折算方案公告

根据《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)的规定,中银聚利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)自《基金合同》生效之日起18个月内,本基金之聚利B份额的基金份额折算基准日为自分级运作周期起始日起满18个月的对应日期,如该日为非工作日,则聚利B的折算基准日为该日前的最后一个工作日。基金管理人将于基金份额折算基准日对聚利B份额进行基金份额折算。现将折算具体事宜公告如下:

1. 折算基准日

聚利B份额的基金份额折算基准日与其分级运作周期到期日为同一个工作日,即2015年12月4日。

2. 折算对象

基金份额折算基准日登记在册的聚利B所有份额。

3. 折算频率

自每个分级运作周期到期日折算一次。

4. 折算方式

折算日日终,聚利B的基金份额净值调整为1.000元,折算后,基金份额持有人持有的聚利B的份额数按照比例相应增减。

聚利B的基金份额折算公式如下:

聚利B的折算比例=折算日折算前聚利B的基金份额净值/1.000

聚利B经折算后的份额数=折算前聚利B的份额数×聚利B的折算比例

聚利B经折算后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财产。

在实施基金份额折算时,折算日折算前聚利B的基金份额净值、聚利B的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

除保留位数因素影响外,基金份额的折算对聚利B份额基金份额持有人的权益无实质性影响。

风险提示:

基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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,由投资者自行负担。

投资者投资基金前应认真阅读《基金合同》、最新的《招募说明书》等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2015年12月2日

# 中银聚利分级债券型证券投资基金之聚利B份额开放申购、赎回业务公告

公告送出日期:2015年12月2日

1. 公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 中银聚利分级债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银聚利分级债券 | |
| 基金主代码 | 000631 | |
| 基金运作方式 | 契约型。本基金以18个月为一个分级运作周期。在每个分级运作周期内,聚利A的开放期为自每个分级运作周期起始日起每6个月即将届满的最后两个工作日的期间。聚利A自分级运作周期起始日起每6个月开放一次申购、赎回,但自分级运作周期起始日起满18个月的开放期只开放赎回,不开放申购;聚利B仅在分级运作周期到期日开放申购、赎回,期间封闭运作且不上市交易。每个分级运作周期到期后,本基金将安排不超过十个工作日的过渡期,办理聚利B的申购、赎回以及聚利A的申购等事宜。 | |
| 基金合同生效日 | 2014年6月5日 | |
| 基金管理人名称 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人名称 | 招商银行股份有限公司 | |
| 基金注册登记机构名称 | 中银基金管理有限公司 | |
| 公告依据 | 《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》的有关约定 | |
| 申购起始日 | 2015年12月4日 | |
| 赎回起始日 | 2015年12月4日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中银聚利分级债券A | 中银聚利分级债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000632 | 000633 |
| 该分级基金是否开放申购、赎回 | – | 是 |

2.申购与赎回的开放日及时间

本基金第一个分级运作周期到期日为2015年12月4日。聚利B在第一个分级运作周期到期日开放申购、赎回。同时将对聚利A和聚利B进行基金份额折算,聚利A和聚利B的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的聚利A和聚利B份额数按折算比例相应增减。

本基金在每个分级运作周期到期后,本基金将安排不超过十个工作日的过渡期,过渡期包括聚利B的开放期和聚利A的申购期二个阶段。其中自过渡期的第一个工作日(2015年12月7日)起本基金继续开放聚利B的申购赎回。

聚利B份额开放期的具体时间为2015年12月4日至2015年12月11日。

3.申购和赎回申请的成交确认原则

第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期的聚利B份额的开放期内,对于聚利B份额赎回申请,所有经确认有效的赎回申请全部予以成交确认。

基金管理人根据市场情况设定第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期内聚利B的份额上限为10亿份。第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期的聚利B份额的开放期内,在每一个开放日,对于聚利B份额申购申请,如果对聚利B份额的全部有效申购申请进行确认后,聚利B份额的份额余额大于聚利B份额的份额上限,则在经确认后的聚利B份额余额不超过其份额上限的范围内,对全部有效申购申请按比例进行成交确认;如果对聚利B份额的全部有效申购申请进行确认后,聚利B份额的份额余额小于或等于其份额上限,则对全部有效申购申请全部予以成交确认。

4 申购和赎回的金额限制

(1)本基金投资者通过基金管理人直销中心柜台、网上直销平台或基金管理人指定的其他销售机构申购聚利B份额时,单笔申购最低金额为人民币50,000元。

投资者可多次申购本基金份额,对单个投资者累计持有基金份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

(2)在第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期内,投资者可申请将其全部或部分聚利B份额基金份额赎回。

(3)基金管理人可与其他销售机构约定,对投资人委托其他销售机构在第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期内办理聚利B份额申购、赎回的,其他销售机构可以按照委托协议的相关规定办理,不必遵守以上限制。

(4)基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。

5 第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期申购费用和赎回费用

(1)第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期申购费用

在第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期的聚利B份额的开放期内进行聚利B份额的申购,聚利B份额的申购费率具体如下:

1)养老金客户通过基金管理人直销柜台申购聚利B份额时,适用如下认购费率:

| | 申购金额(M) | 申购费率 |
|---|---|---|
| 申购费用 | M<100万 | 0.32% |
| | 100万≤M<200万 | 0.20% |
| | 200万≤M<500万 | 0.12% |
| | M≥500万 | 1000元每笔 |

注:养老金客户指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,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。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,基金管理人可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。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

2)除养老金客户以外的其他投资者申购聚利B份额时,适用如下认购费率:

| | 申购金额(M) | 申购费率 |
|---|---|---|
| 申购费用 | M<100万 | 0.8% |
| | 100万≤M<200万 | 0.5% |
| | 200万≤M<500万 | 0.3% |
| | M≥500万 | 1000元每笔 |

聚利B份额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。

(2)第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期赎回费用

在过第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期的聚利B份额的开放期内进行聚利B份额的赎回,不收取赎回费用。

(3)销售机构可以在法律、行政法规及中国证监会允许的范围内对基金销售费用实行一定的优惠,并应按《信息披露办法》的要求进行公告。

6.1 场外销售机构

6.1.1 直销机构

名称:中银基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼

法定代表人:白志中

电话:(021)38834999

传真:(021)68872488

联系人:徐琳

6.1.2 其他场外销售机构

1) 中国银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:田国立

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

2)招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南大道7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人: 李建红

客服电话: 95555

联系人: 邓炯鹏

网址: www.cmbchina.com

3)申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人: 李梅

联系人: 黄莹

客服电话: 95523

公司网站: www.swhysc.com

6.2 场内销售机构

无。

7. 其他需要提示的事项

1. 本公告仅对聚利B在本基金第一个分级运作周期到期日及到期后过渡期开放申购、赎回业务的有关事项予以说明。

2. 投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》等法律文件。投资者亦可拨打本公司的客户服务电话:021-38834788 / 400-888-5566或登陆本公司网站www.bocim.com了解相关情况。

3. 有关聚利B本次开放日开放申购、赎回的具体规定若有变化,基金管理人将另行公告。

4. 风险提示:

基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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,由投资者自行负担。

投资者投资基金前应认真阅读基金合同、最新的招募说明书等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2015年12月2日

# 中银聚利分级债券型证券投资基金之聚利A份额折算方案公告

根据《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)的规定,中银聚利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)在每个分级运作周期内,聚利A的基金份额折算基准日为分级运作周期起始日起每满6个月的日期,如该日为非工作日,则聚利A的基金份额折算基准日为该日前的最后一个工作日。因不可抗力或其他情形致使聚利A无法按时开放申购与赎回的,折算基准日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。现将折算具体事宜公告如下:

1. 折算基准日

聚利A份额的基金份额折算基准日与分级运作周期到期日为同一个工作日,即2015年12月4日。

2. 折算对象

基金份额折算基准日登记在册的聚利A份额所有份额。

3. 折算频率

自《基金合同》生效之日起每满6个月折算一次。

4. 折算方式

折算日日终,聚利A份额的基金份额净值调整为1.000元,折算后,基金份额持有人持有的聚利A份额的份额数按照比例相应增减。

聚利A份额的基金份额折算公式如下:

聚利A份额的折算比例=折算日折算前聚利A份额的基金份额净值/1.000

聚利A份额经折算后的份额数=折算前聚利A份额的份额数×聚利A份额的折算比例

聚利A份额经折算后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财产。

在实施基金份额折算时,折算日折算前聚利A份额的基金份额净值、聚利A份额的折算比例的具体计算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

除保留位数因素影响外,基金份额的折算对聚利A份额基金份额持有人的权益无实质性影响。

风险提示:

基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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,由投资者自行负担。

投资者投资基金前应认真阅读《基金合同》、最新的《招募说明书》等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2015年12月2日

# 中银聚利分级债券型证券投资基金之聚利A份额开放赎回业务公告

公告送出日期:2015年12月2日

1. 公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 中银聚利分级债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银聚利分级债券 | |
| 基金主代码 | 000631 | |
| 基金运作方式 | 契约型。本基金以18个月为一个分级运作周期。在每个分级运作周期内,聚利A的开放期为自每个分级运作周期起始日起每6个月即将届满的最后两个工作日的期间。聚利A自分级运作周期起始日起每6个月开放一次申购、赎回,但自分级运作周期起始日起满18个月的开放期只开放赎回,不开放申购;聚利B仅在分级运作周期到期日开放申购、赎回,期间封闭运作且不上市交易。每个分级运作周期到期后,本基金将安排不超过十个工作日的过渡期,办理聚利B的申购、赎回以及聚利A的申购等事宜。 | |
| 基金合同生效日 | 2014年6月5日 | |
| 基金管理人名称 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人名称 | 招商银行股份有限公司 | |
| 基金注册登记机构名称 | 中银基金管理有限公司 | |
| 公告依据 | 《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》的有关约定 | |
| 赎回起始日 | 2015年12月3日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中银聚利分级债券A | 中银聚利分级债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000632 | 000633 |
| 该分级基金是否开放赎回 | 是 | – |

2. 日常赎回业务的办理时间

根据《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,中银聚利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)之聚利A份额(以下简称“聚利A份额”)在每个分级运作周期内,聚利A的开放期为自每个分级运作周期起始日起每6个月即将届满的最后两个工作日的期间。聚利A的开放日分为赎回开放日和申购开放日;自每个分级运作周期起始日起满6个月、12个月的开放期的第一个开放日为赎回开放日,第二个开放日为申购开放日。聚利A的赎回开放日只开放聚利A的赎回,不开放聚利A的申购;聚利A的申购开放日只开放聚利A的申购,不开放聚利A的赎回。自每个分级运作周期起始日起满18个月的开放期的两个开放日均为聚利A的赎回开放日。因不可抗力或其他情形致使聚利A无法按时开放申购与赎回的,开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下两个工作日。

2015年12月3日和2015年12月4日为聚利A第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放期,该两个开放日均为聚利A的赎回开放日,聚利A的赎回开放日只开放聚利A的赎回,不开放聚利A的申购。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停聚利A的赎回时除外。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理聚利A的赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出聚利A的赎回申请,视为无效申请。

3.日常赎回业务

3.1 赎回份额限制

在聚利A的开放日,投资者可申请将其全部或部分聚利A份额赎回。如遇巨额赎回等情况发生而导致延缓支付赎回款项时,赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回的条款处理。

3.2 赎回费率

聚利A无赎回费。

3.3 其他与赎回相关的事项

1、基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人按“先进先出”的原则,对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理,即注册登记确认日期在先的基金份额先赎回,注册登记确认日期在后的基金份额后赎回,以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率。

2、在聚利A的开放日,所有经确认有效的聚利A份额的赎回申请全部予以成交确认。

3、聚利A的开放日(T日)的下一个工作日(T+1日),基金注册登记机构对投资者的赎回申请进行确认。在T+2日后(包括该日),投资者可至销售机构网点或以销售机构规定的其他方式查询赎回申请的确认情况。

4、基金销售机构对聚利A赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到聚利A赎回申请。聚利A赎回申请的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。聚利A每次开放日的赎回确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

4. 基金销售机构

4.1 场外销售机构

4.1.1 直销机构

名称:中银基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼

法定代表人:谭炯

电话:(021)38834999

传真:(021)68872488

联系人:徐琳

4.1.2 其他场外销售机构

1) 中国银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:田国立

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

2)招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南大道7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人: 李建红

客服电话: 95555

联系人: 邓炯鹏

网址: www.cmbchina.com

3)申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人: 李梅

联系人: 黄莹

客服电话: 95523

公司网站: www.swhysc.com

4.2 场内销售机构

无。

5. 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排

在聚利A的第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放期的第二个开放日日终,聚利A份额的基金份额净值调整为1.000元,折算后,基金份额持有人持有的聚利A份额的份额数按照比例相应增减。

在聚利A的第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放期的第二个开放日的次日,即2015年12月7日,基金管理人将公告聚利A份额的基金份额净值,即折算调整后的份额净值1.000元。

在聚利A的第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放期的第二个开放日当日,披露的净值仍然为折算日前一日的基金份额参考净值。

在聚利A的第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放期的第二个开放日当日,按照1.000元的基金份额净值办理聚利A的赎回。

6. 其他需要提示的事项

1. 本公告仅对聚利A在本基金第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放期,即2015年12月3日和2015年12月4日开放赎回业务的有关事项予以说明。

2. 投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读《中银聚利分级债券型证券投资基金基金合同》、《中银聚利分级债券型证券投资基金招募说明书》等法律文件。投资者亦可拨打本公司的客户服务电话:021-38834788 / 400-888-5566或登陆本公司网站www.bocim.com了解相关情况。

3. 本基金的每个分级运作周期内,聚利A份额自分级运作周期起始日起每6个月开放一次申购、赎回,但在第三个开放期仅开放赎回,不开放申购,且聚利A份额不上市交易,并获得应计约定收益;聚利B份额不上市交易,获得扣除聚利A份额本金和应计约定收益后的基金剩余净资产。本基金的净资产优先分配聚利A份额的本金及约定收益,本基金净资产在优先分配聚利A份额的本金及约定收益总额后的剩余净资产分配给聚利B份额。但基金管理人并不承诺或保证聚利A份额持有人能够获得《基金合同》规定的约定收益,在本基金资产出现极端损失情况下,聚利A份额仍可能面临无法取得累计每日约定收益乃至投资本金受损的风险。如本基金净资产等于或低于聚利A份额的本金及约定收益的总额,则本基金净资产全部分配给聚利A份额后,仍存在额外未弥补的聚利A份额的本金及约定收益总额的差额,不再进行弥补。

4. 本基金的每个分级运作周期内,聚利A份额的基金份额折算基准日为基金合同生效之日起每满6个月的日期,如该日为非工作日,则为该日前的最后一个工作日。折算日日终,聚利A份额的基金份额净值调整为1.000元,折算后,基金份额持有人持有的聚利A份额份额数按折算比例相应增减。具体的折算方式及折算结果见基金管理人届时发布的相关公告。

5. 聚利A份额根据基金合同的规定获取年化约定收益率,其年化约定收益率在基金合同生效当日或在每个开放期前一个工作日设定一次并公告,计算公式为:1.1×一年期定期存款利率+利差。

第二个分级运作周期开始之后6个月内,聚利A份额适用的利差值为2.47%。

基金管理人根据2015年12月1日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期银行定期存款基准利率重新设定聚利A份额年化约定收益率中的一年期定期存款利率值,用于计算第二个分级运作周期开始之后6个月的聚利A份额每日约定收益。

聚利A份额的应计收益的金额采用单利计算。聚利A份额的年化约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后2位。

有关聚利A份额年化约定收益率计算的具体规定,请仔细阅读本基金《基金合同》和《招募说明书》。

6. 有关聚利A本次开放日开放赎回的具体规定若有变化,基金管理人将另行公告。

7. 风险提示:

基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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,由投资者自行负担。

投资者投资基金前应认真阅读基金合同、最新的招募说明书等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2015年12月2日

# 关于中银聚利分级债券型证券投资基金之聚利A份额年化约定收益率设定的公告

中银聚利分级债券型证券投资基金(以下或简称“本基金”)基金合同已于2014年6月5日生效。根据本基金基金合同中关于中银聚利分级债券型证券投资基金之聚利A份额(场内简称:中银聚A,基金代码:000632)年化约定收益率的相关规定,聚利A份额的年化约定收益率计算公式如下:

聚利A份额的年化约定收益率 = 1.1×一年期定期存款利率(税后)+利差

聚利A份额根据基金合同的规定获取年化约定收益率,其年化约定收益率在每个开放期的前一个工作日设定一次并公告。

一年期定期存款利率指:在《基金合同》生效日的前两个工作日,中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期银行定期存款基准利率(税后);在聚利A的每个开放期的前一个工作日,基金管理人将根据开放期前两个工作日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期银行定期存款基准利率(税后)重新设定聚利A的年化约定收益率中的一年期定期存款利率值,并用于下6个月的每日约定收益的计算。

视国内利率市场变化,基金管理人在聚利A份额的每个开放日前公告下6个月聚利A份额适用的约定收益的利差值。利差的取值范围从0.5%(含)到3.0%(含)。

聚利A份额的应计收益的金额采用单利计算。聚利A份额的年化约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后2位。

根据本基金基金合同,本基金第二个分级运作周期内,聚利A份额第二个分级运作周期开始之后6个月适用的利差设定为2.47%。

聚利A份额于2015年12月3日、2015年12月4日进行第一个分级运作周期起始日起满18个月的开放赎回,鉴于2015年12月1日中国人民银行公布的金融机构人民币1年期银行定期存款基准年利率为1.50%,因此本基金第二个分级运作周期开始之后6个月,聚利A份额的年化约定收益率为4.12%(1.1×1.50%+2.47%=4.12%)。

风险提示:

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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,由投资者自行负担。

投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

本基金基金份额持有人及希望了解本基金其他有关信息的投资者,可以登录本基金管理人网站(http://www.bocim.com/)或拨打客户服务电话(400-888-5566/021-38834788)咨询相关事宜。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2015年12月2日

(上接B65版)

**四、基金的名称**

国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)由金盛证券投资基金转型而成。

**五、基金类型和存续期限**

1、基金的类别:混合型证券投资基金;

2、基金的运作方式:契约型开放式;

3、基金存续期限:不定期。

4、基金类别的变更:根据2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)的约定,本基金自2015年8月8日起基金类别变更为混合型基金,基金名称由“国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)”修改为“国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)”,基金合同部分条款相应修订。

**六、投资目标**

本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。

**七、投资范围**

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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

本基金股票资产投资比例占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中,权证投资比例占基金资产净值的0-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有高成长性和良好基本面的中小盘成长股票。

基金管理人每季末将对中国A股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加,选择累计流通市值占A股总流通市值前1/2的股票,称为中小盘股票。

如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式,本基金将予以相应调整,并提前三个工作日公告变更后具体的计算方法。

如法律法规或中国证监会修改对基金投资品种的规定,基金管理人在履行相应程序后,可以依据新的规定修订基金的投资范围及投资比例。

**八、投资策略**

基金管理人在构建投资组合的过程中,遵循以下投资策略:

1、资产配置策略

根据宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测未来一段时间内固定收益市场、股票市场的风险与收益水平,结合基金合同的资产配置范围、组合投资止损点,借助风险收益规划模型,得到一定阶段股票、债券和现金资产的配置初始比例,再进行综合的对比分析和评估后作出大类资产配置方案。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置:

战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险,然后确定最能满足基金风险-回报率目标的资产组合。

战术性资产配置根据过去的各类资产长短期平均回报率不同,预测其未来的短期性回报率,调整资产配置,获取市场时机选择的超额收益。

2、股票投资策略

(1)股票选择过程

本基金的股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象,采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。首先,通过对股票的流通市值进行排序,构成中小盘上市公司股票池;其次,利用“成长因子”筛选出具有成长性的上市公司,构成具有成长优势的中小盘股票池;最后,通过相对价值评估以及实地调研,选择价值被低估上市公司,形成优化的股票投资组合。

(2)成长型股票筛选

本基金对中小盘股票池的股票的成长性筛选采用“成长因子”,主要包括销售收入增长率、净利润增长率、总资产增长率、净资产收益率增长率等,对上市公司进行成长性评价,分析和预测企业未来的成长性,剔除不符合本基金投资要求的股票,筛选出近期成长性高的股票,形成二级股票备选池。

(3)相对价值评估分析

在二级股票备选池范围内,本基金利用相对价值评估,形成可投资的股票组合。相对价值评估主要运用国际化视野,采用专业的估值模型,合理使用估值指标,将国内上市公司的有关估值与国际公司相应指标进行比较,选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括股息贴现模型、自由现金流贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA等方法。

(4)实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司,公司投资研究团队将实地调研上市公司,深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性,投资研究团队还将通过上市公司的上游供货商、下游客户、竞争对手和业务合作伙伴,以及税务、海关等行政管理部门对调研结论进行核实。

(5)建立投资组合

本基金将在案头分析和实地调研的基础上,建立买入和卖出股票名单,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。

3、债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

以对长期利率预期为基础确定期限结构。在预期利率下降时,增加组合久期,提高债券价格上升产生的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,降低债券价格下降产生的损失。如果预期市场收益率曲线作强烈的整体向上平移,降低债券组合的整体持仓比例,同时降低组合久期,来使组合损失降到最低。

以收益率曲线分析为基础确定收益率曲线配置。根据收益率曲线可能发生变动的种类,如平坦化、陡峭化、正向蝴蝶型、反向蝴蝶型等,通过子弹形、哑铃形和梯形等配置方法,在短、中、长期债券间确定比例,以期从短、中、长期债券的相对价格差中取得收益。

以相对利差分析为基础确定类属配置。通过对各类属债券历史利差的数量化分析,寻找市场投资机会。比如在预期国债与金融债利差缩小时,卖出国债,买入金融债。

以流动性分析和收益率分析为基础确定市场配置。交易所国债市场发行总量较小,大额交易流动性较差、小额交易流动性较好,而银行间国债市场发行总量较大,大额交易成本低,某些时段流动性较好。故根据不同时段对流动性的不同需求,在两个市场间配置债券资产。

在通过上述配置方法构建债券组合之后,本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调整:

短期经济运行指标,如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动,引起的市场实际利率的变动;

中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动,导致整个投资组合重新估价;

央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向,从而引起债券市场结构性调整;

债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与认购情况发生变化,导致二级市场收益率产生波动;

由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价;

市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动;

单个券种或某一类别债券的定价偏差,也就是市场失衡导致的投资机会等。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

**九、业绩比较基准**

本基金的业绩基准=35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数

天相风格指数系列包含三个规模风格指数——天相大盘、天相中盘和天相小盘,以及六个价值成长风格指数——大盘价值、大盘成长、中盘价值、中盘成长、小盘价值和小盘成长。编制方法是:将股票按照流通市值排序,累计流通市值前30%的股票为天相大盘,累计流通市值中间40%的股票为天相中盘,累计流通市值后30%的股票为天相小盘。然后在每个规模类中将股票按照B/P值分成价值成长,并保证每个规模类的价值成长指数的流通市值相同。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金,或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数,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。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

**十、风险收益特征**

本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

**十一、基金投资组合报告**

本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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止2015年9月30日,本报告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 | 234,477,116.05 | 79.75 |
| | 其中:股票 | 234,477,116.05 | 79.75 |
| 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 | 58,994,309.21 | 20.06 |
| 7 | 其他各项资产 | 556,398.96 | 0.19 |
| 8 | 合计 | 294,027,824.22 | 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 | – | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 158,372,528.31 | 55.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 11,342,544.00 | 3.94 |
| F | 批发和零售业 | 6,872,715.76 | 2.39 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | – | – |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,109,290.59 | 4.91 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | 14,931,280.00 | 5.19 |
| 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 | 28,848,757.39 | 10.03 |
| 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 | – | – |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 234,477,116.05 | 81.53 |

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 | 300376 | 易事特 | 793,754 | 27,646,451.82 | 9.61 |
| 