（上接B006版）

经办律师：廖海、吴军娥

（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有限责任公司

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：上海市长乐路989号世纪商贸广场23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

富国优化增强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

本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。

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债券、股票、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。本基金投资于债券等固定收益类资产（含可转债券）的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中，权证投资的比例不超过基金资产净值的3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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

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。本基金在债券投资过程中突出主动性的投资管理，在对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势进行客观判断的基础上，通过合理配置收益率相对较高的企业债、公司债、资产支持证券，以及风险收益特征优异的可转换债、可分离债券、可交换债券等债券品种，加以对国家债券、金融债券、中央银行票据以及回购等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略，在保证基金流动性的前提下，积极把握固定收益证券市场中投资机会，获取各类债券的超额投资收益。

1、资产配置策略

①整体资产配置策略

本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，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，预测各类资产在长、中、短期收益率的变化情况，进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币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

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，有必要将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。在整体资产配置策略的指导下，本基金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）、资产证券化产品、金融创新（各类金融衍生工具等）四个子市场，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、固定收益类产品投资策略

①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。

②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。

③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。

④回购套利策略

基金管理人在发现债券市场明显投资机会的情况下，或债券市场存在套利机会时，通过回购等融资融券手段，应用适量的杠杆获取超额收益。

3、股票投资策略

①一级市场新股申购策略

本基金将深入研究首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面，挖掘公司的内在价值，根据当时股票市场整体投资环境及定价水平，发行折价水平及一、二级市场间资金供求关系，在有效控制风险的前提下制定相应的新股认购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

②二级市场股票投资策略

当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本基金可以直接参与股票二级市场投资，努力获取超额收益。在二级市场投资过程中，本基金主要采取自下而上的投资策略，借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团（BMO Financial Group）的投资管理经验及技能，结合国内市场的特征，利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法，对以下三类上市公司进行投资：

①现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红纪录或现金分红潜力的优质上市公司；

②投资价值明显被市场低估的上市公司；

③未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。

4、权证投资策略

在确保与基金投资目标一致以及风险可控的前提下，本基金可适度进行谨慎的权证投资。基金对权证投资的目标首先是控制并降低组合风险，其次是令基金资产增值。本基金的权证投资策略包括：

①采用市场认可的多种期权定价模型并根据研究人员对公司基本面等因素的分析，形成合理的对权证的定价；

②对标的股票进行价值判断，结合权证市场发展的具体情况，决策权证的买入、持有或沽出操作；

③本基金权证投资策略包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等。

5.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。

6.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最终的资产分布比例、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：中债综合指数收益率＊90%+沪深300指数收益率＊10%。

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较低风险品种，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	96,715,756.54	10.68
	其中：股票	96,715,756.54	10.68
2	固定收益投资	717,943,643.10	79.27
	其中：债券	717,943,643.10	79.27
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	72,391,863.09	7.99
6	其他资产	18,658,472.21	2.06
7	合计	905,709,734.94	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	55,973,708.15	11.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	40,742,048.39	8.37
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	96,715,756.54	19.87

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	600060	海信电器	905,258	11,523,934.34	2.37
2	300083	劲胜股份	567,574	10,795,257.48	2.22
3	000921	ST科 龙	1,230,103	10,160,650.78	2.09
4	600030	中信证券	631,683	7,687,582.11	1.58
5	601166	兴业银行	403,590	6,982,107.00	1.43
6	002550	千红制药	224,654	6,903,617.42	1.42
7	002055	得润电子	821,476	6,218,573.32	1.28
8	600016	民生银行	606,300	5,844,732.00	1.20
9	601998	中信银行	1,174,800	5,486,316.00	1.13
10	600111	包钢稀土	171,500	5,114,130.00	1.05

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	-	-
2	央行票据	29,979,000.00	6.16
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	268,102,503.00	55.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	419,862,140.10	86.25
8	其他	-	-
9	合计	717,943,643.10	147.49

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	110015	石化转债	1,368,560	153,333,462.40	31.50
2	113002	工行转债	1,182,430	127,737,912.90	26.24
3	0980100	09常高新债	500,000	50,340,000.00	10.34
4	113003	重工转债	389,840	45,084,996.00	9.26
5	110013	国投转债	245,000	32,923,100.00	6.76

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

注：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名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、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

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。

9、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	177,205.20
2	应收证券清算款	7,705,379.15
3	应收股利	-
4	应收利息	9,586,179.84
5	应收申购款	1,189,708.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,658,472.21

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	110015	石化转债	153,333,462.40	31.50
2	113002	工行转债	127,737,912.90	26.24
3	113003	重工转债	45,084,996.00	9.26
4	110013	国投转债	32,923,100.00	6.76
5	110018	国电转债	31,087,399.20	6.39

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	000921	ST科 龙	10,160,650.78	2.09	重大诉讼未决

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

基金管理人依照格尽职守、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、富国优化增强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

①AB级

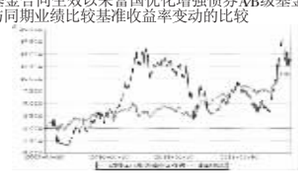
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009.6.10-2009.12.31	0.20%	0.30%	2.20%	0.20%	-2.00%	0.10%
2010.1.1-2010.12.31	14.65%	0.39%	0.77%	0.17%	13.88%	0.22%
2011.1.1-2011.12.31	-10.07%	0.47%	2.00%	0.15%	-12.07%	0.32%
2012.1.1-2012.12.31	5.45%	0.32%	4.18%	0.13%	1.27%	0.19%
2013.1.1-2013.3.31	4.39%	0.97%	1.21%	0.16%	3.18%	0.81%
2009.6.10-2013.3.31	13.71%	0.44%	10.76%	0.16%	2.95%	0.28%

②C级

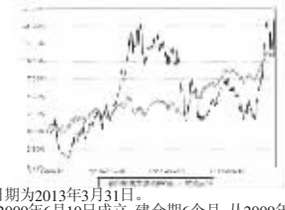
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009.6.10-2009.12.31	0.00%	0.30%	2.20%	0.20%	-2.20%	0.10%
2010.1.1-2010.12.31	14.07%	0.39%	0.77%	0.17%	13.30%	0.22%
2011.1.1-2011.12.31	-10.43%	0.46%	2.00%	0.15%	-12.43%	0.31%
2012.1.1-2012.12.31	4.99%	0.32%	4.18%	0.13%	0.81%	0.19%
2013.1.1-2013.3.31	4.26%	0.96%	1.21%	0.16%	3.05%	0.80%
2009.6.10-2013.3.31	11.84%	0.44%	10.76%	0.16%	1.08%	0.28%

2、自基金合同生效以来基金累计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：

①自基金合同生效以来富国优化增强债券AB级基金累计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



②自基金合同生效以来富国优化增强债券C级基金累计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：截止日期为2013年3月31日。

本基金于2009年6月10日成立，建仓期6个月，从2009年6月10日至2009年12月9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本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

④基金财产拨划支付的银行费用；

⑤基金合同生效后的基金信息披露费用；

⑥基金份额持有人大会费用；

⑦基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

⑧基金的证券交易费用；

⑨依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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。

3、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0.7%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销售服务费

本基金A类和B类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.4%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。

④除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，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。

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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率和基金销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率，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2日前在指定媒体上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

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投资者在申购A类基金份额时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减。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。本基金A类基金份额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。

具体如下：

A、申购费率

申购金额(含申购费)	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以外的其他A类基金份额的投资者。

B、特定申购费率

申购金额(含申购费)	特定申购费率
100万元以下	0.24%
100万元(含)—500万元	0.15%
500万元(含)以上	1000元/笔

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金A类基金份额的养老金客户，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。

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投资者在申购B类基金份额时需交纳后端申购费，费率按持有时间递减，具体如下：

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

③投资者在申购C类基金份额时不需要交纳申购费用。

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。

本基金对A类、B类及C类基金份额收取赎回费，在投资者赎回时收取。

A类、B类及C类基金份额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：

持有年限	A类、B类基金份额赎回费率	C类基金份额赎回费率
30天以下	0.1%	0.1%
30天(含)—1年(含)	0.1%	0
1年—2年(含)	0.05%	0
2年以上	0	0

基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定，在履行相应程序后调整申购费率和调低赎回费率，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

①前端转前端

基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。其中：转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用；转入基金申购补差费是按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式，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。基金转换的计算公式如下：

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入金额=转出金额-转出基金赎回费

净转入金额=转入金额÷（1+申购补差费率）

申购补差费=转入金额-净转入金额

转入份额=净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值

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。

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。

基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记人处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

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）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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、主要人员情况等内容进行了更新。

3、“四、基金托管人”部分对基金托管人基本情况、基金托管业务经营情况等内容进行了更新。

4、“五、相关服务机构”部分对直销机构、代销机构、注册登记机构部分信息进行了更新。

5、“九、基金份额的申购与赎回”部分对本基金代销机构名单、本基金申购费率等内容进行了更新，完善了可与本基金转换的基金名单，更新了基金转换的业务规则。

6、“九、基金的投资”部分对投资组合报告更新至2013年3月31日。

7、“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2013年3月31日，并更新了历史走势对比图。

8、“十七、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、“二十、基金托管协议的内容摘要”部分更新了基金托管人的注册资本。

10、“二十二、其他应披露事项”部分对本报告期内的应披露事项予以更新。

富国基金管理有限公司

二〇一三年七月二十三日

证券简称：云南城投　　证券代码：600239　　公告编号：临2013-039号

云南城投置业股份有限公司 关于下属公司名称变更的公告

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。

近日，云南城投置业股份有限公司（下称“公司”）下属公司云南省绿色产品交易中心有限公司名称变更为“云南鑫城佳置业有限公司”（下称“该公司”），其余事项均无变化。

目前，该公司正处于股权转让过程中。公司将根据该公司股权转让事宜的进展情况进行持续披露。

特此公告。

云南城投置业股份有限公司董事会

2013年7月23日

证券代码：600239　　证券简称：云南城投　　公告编号：临2013-040号

云南城投置业股份有限公司 关于控股股东增持公司股份的公告

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。

2013年7月22日，云南城投置业股份有限公司（下称“公司”）接到公司控股股东云南省城市建设投资集团有限公司（下称“省城投集团”）通知，省城投集团通过上海证券交易所交易系统增持了公司部分股份。现将有关情况公告如下：

一、本次增持情况

2013年7月22日，省城投集团通过上海证券交易所交易系统首次增持公司股份4，874，952股，占公司总股本的0.59%。

本次增持前，省城投集团持有公司股份254，126，381股，占公司总股本的30.86%；本次增持后，省城投集团持有公司股份259，001，333股，占公司总股本的31.45%。

截至目前，省城投集团所持公司全部股份均为无限售条件流通股份。

二、后续增持计划

基于对目前资本市场形势的认识和判断，以及对公司未来发展前景的信心，为了维护公司二级市场股价的稳定和保护广大投资者的利益，省城投集团拟在未来6个月内（自本次增持首日起算，即2013年7月22日起算），根据中国证监会和上海证券交易所的相关规定以及资本市场情况，以自身名义继续通过上海证券交易所交易系统增持公司股份，累计增持比例不超过公司已发行股份总数的2%，即不超过16，468，583股（含本次已增持股份）。

三、本次增持行为符合《中华人民共和国证券法》等法律法规、部门规章及上海证券交易所业务规则等有关规定。

四、省城投集团承诺，在增持实施期间及法定期限内不减持所持有的公司股份。

五、公司将根据《上海证券交易所股票上市规则》（2012年修订）、《上市公司收购管理办法》（2012年修订）和《上海证券交易所上市公司股东及其一致行动人增持股份行为指引》（2012年修订）的相关规定，持续关注省城投集团所增持公司股份的有关情况，及时履行信息披露义务。

特此公告。

云南城投置业股份有限公司董事会

2013年7月23日

证券代码：600462　　证券简称：石岘纸业　　编号：临2013-031

延边石岘白麓纸业股份有限公司 关于诉讼事项进展的公告

特别提示

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。

一、有关本案的基本情况

2007年元月，原告新乡市天盛流体净化设备有限公司（以下简称“净化公司”）按照延边石岘白麓纸业股份有限公司（以下简称“本公司”）提供的图纸加工滤网，合同约定货到付款或凭增值税票结算。截止到2011年9月1日，本公司仍欠原告货款302，208.31元。原告请求本公司支付302，208.31元，并从2008年6月1日起支付利息；本案的诉讼费用由本公司承担。案件详情请见本公司于2012年12月12日在《中国证券报》、《上海证券报》和上海证券交易所（www.sse.com.cn）发布的关于收到新乡市卫滨区人民法院传票的公告。

二、诉讼进展情况

本公司于2013年7月22日，收到河南省新乡市卫滨区人民法院（2011）卫滨民二初字第74号民事判决书、河南省新乡市中级人民法院（以下简称“新乡中院”）（2013）新中民二终字第166号民事判决书。

新乡中院认为，被上诉人净化公司与原审被告本公司之间债权债务关系明确，本公司应当支付被上诉人净化公司货款及利息。但上诉人延边石岘白麓纸业销售有限公司（以下简称“销售公司”）与原审被告本公司皆为独立法人，原审法院判决上诉人销售公司对本案本公司欠净化公司的债务承担连带清偿责任没有法律依据。上诉人销售公司上诉称原审判决判令其公司承担连带清偿责任错误的上诉理由成立，本院予以支持。综上，原审判决认定事实清楚，但适用法律错误。依照《中华人民共和国民事诉讼法》第一百七十条第一款第（二）项之规定，判决如下：

1、维持河南省新乡市卫滨区人民法院（2011）卫滨民二初字第74号民事判决第一项即被告本公司于本判决生效后五日内支付原告净化公司货款302，208.31元及利息。（利息以302，208.31元为基数，自2008年6月1日起计至债务人履行完债务之日止，利率按中国人民银行规定的同期贷款基准利率计算）；

2、撤销河南省新乡市卫滨区人民法院（2011）卫滨民二初字第74号民事判决第二项即被告销售公司对本判决第一项承担连带责任；

3、驳回净化公司对销售公司的诉讼请求。

一审诉讼费5，830元，二审案件诉讼费5，830元，共计11，660元，由本公司负担。

本判决为终审判决。

三、是否有其他尚未披露的诉讼、仲裁事项

截至目前，本公司及控股子公司没有尚未披露的小额诉讼或仲裁事项，公司及控股子公司亦没有应披露而未披露的其他诉讼、仲裁事项。

四、本次公告的诉讼事项对公司本期利润或期后利润的影响

本次公告的诉讼事项对公司本期利润或期后利润没有影响。

五、其它情况

公司将按照吉林省延边朝鲜族自治中级人民法院（2011]延中民三破字第1-2号）民事裁决书裁准的重整计划偿债标准，偿还净化公司债权。

特此公告

延边石岘白麓纸业股份有限公司董事会

2013年7月22日

证券代码：002659　　证券简称：中泰桥梁　　公告编号：2013-41

江苏中泰桥梁钢构股份有限公司关于海滨大道跨海大桥工程投标的提示性公告

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。

连云港市交通运输局于2013年5月29日公布了《海滨大道跨海大桥工程的招标公告》，于2013年6月6日公布了《二次