

(更新)摘要

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资组合和关联交易情况说明

1. 报告期末本基金投资组合资产配置情况

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。

(十) 报告期末本基金投资组合和关联交易情况说明

1. 本报告期内未投资股指期货。

2. 报告期末未投资股指期货。

3. 本基金本报告期末未投资股指期货。

4. 报告期末未投资股指期货。

5. 本报告期内未投资股指期货。

(十一) 关联交易合规报告

本基金本报告期未发生前十大重仓股的发行主体、基金本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告期内一年内受到公开谴责、处罚的情形。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	188,109.65
2	应收证券清算款	2,500,000.00
3	应收股利	—

4	应收利息		28,169,578.75
5	应收申购款		76,196.94
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8	其他		
9	合计		30,933,885.34

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	110023	民生转债	119,002,108.40	7.12

2	110028	冠城转债	4,866,300.00	0.29
3	128007	通鼎转债	1,378,862.40	0.08
4	128005	齐翔转债	1,363,930.70	0.08

5、报告期内前十名股票中存在受股东受领情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受领部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受领情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	000087	中银股份	40,228,912.24	2.41	重大事项
2	000502	绿景控股	32,527,519.14	1.95	重大事项

6 投资组合符合投资的其他文字描述及说明

由于四舍五入的原因,分项之和与合计可能有尾差。

②、基金业绩比较

基金管理人以跟踪母基金资产净值、诚实守信、勤勉尽责的资产管理原则管理基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金业绩比较基准为:中银基金业绩比较基准。投资管理人定期或不定期跟踪并详细阐述本基金的投资策略和说明。

本基金投资业绩的衡量标准及与业绩比较基准收益比较表如下:

阶段	份额净值 增长率 率①	份额净值 增长率 率②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率④	①-③	②-④
----	-------------------	-------------------	--------------------	--------------------	-----	-----

2012.05.28-2012.12.31	1.30%	0.03%	2.63%	0.01%	-1.33%	0.02%
2013.01.01-2013.12.31	0.59%	0.28%	4.31%	0.01%	-3.72%	0.27%
2014.01.01-2014.12.31	20.02%	0.45%	4.28%	0.01%	15.74%	0.44%
2015.01.01-2015.03.31	12.67%	0.63%	0.98%	0.01%	11.69%	0.62%
2012.05.28-2015.03.31	37.80%	0.37%	12.20%	0.01%	25.60%	0.36%

注：本基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×60%+固定收益类资产收益率×40%。

二、自基金合同生效以来基金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：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

十四、费用概览

(一)基金的费用种类

- 1.基金管理人管理费；
- 2.基金托管人托管费；
- 3.因基金财产证券交易结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结清费及其他类似性质的费用等）；
- 4.基金合同生效以后的信息披露费用；

6. 基金份额持有人大会费；
7. 基金合同生效以后的会计师费和律师费和诉讼费；
7. 基金资产的资金汇划费；
8. 按照国家有关法律法規规定可以列入的其他費用。

(二) 与基金运作有关的費用

1. 基金管理人的管理費

基金管理人管理基金资产費按基金财产淨值的1.2%年費率計提。

在通常情况下，基金管理費按前一日本基金财产淨值的1.2%年費率計提。計算方法如下：

H = $\text{R} \times \text{X} / 2$ - 当年天数
H为每日应计提的基金管理费
R为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
在基金财产中,本基金应扣除费用从基金资产的管理费收入中列支。
基金托管人的管理费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费计提。
在基金财产中,基金托管费按照前一日基金财产净值0.25%的年费率计提,计提方法如下:

H为H+0.2%×当日天数

日=每日计提的基金托管费

C为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人及基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、保本到期后赎回,若本基金按合同约定变更至“安聚精选灵活配置型证券投资基金”,则基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法同上。

上述一、基金费用的种类中列第3-8项费用由基金管理人及基金托管人根据有关法律法规及相应协议的约定,则当期

（三）与基金销售有关的使用

1. 认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，如下表所示：

认购金额(M)	认购费率
M<\$0万元	1.0%
\$0万元≤M<\$200万元	0.6%

200万元 ≤ M < 500万元	0.4%
M ≥ 500万元	每笔1000元

认份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额面值

2. 申购费

申购金额 (M)	申购费率
M < 50 万元	1.2%
50 万元 ≤ M < 200 万元	0.8%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.6%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

申购份额的计算方法如下：
 净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)
 申购费用 = 申购金额 - 净申购金额
 申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值
 本基金中的申购费用由申购人承担，用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，由基金管理人支配使用，不列入基金财产。
 若保本基金到期后，本基金不符合保本基金的存续条件，转为变更后的“诺安策略精选股票型证券投资基金”，申购费率不高于申购前期限，具体费率以届时公告为准。

持有年限(T)	赎回费率
T<1年	2.0%
1年≤T<2年	1.6%
2年≤T<3年	1.2%

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{T日基金份额净值}$$
$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$
$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

投资者在将其持有的全部或部分基金份额赎回时，本基金的赎回费用在投资人赎回基金份额时收取，赎回费用由赎回人承担，其中25%的部分归基金资产所有，其余额部分用于注册登记等相关费用。

若基金份额到期后，本基金不符合保本基金存续条件，则变为普通的“诺安双精选股票型证券投资基金”，赎回

费率最高不超过5%，具体费率以届时公告为准。

4.转换费

(1)基金转换费用

基金转换费用由转出基金的赎回费用以及相应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高低和赎回费率而定，其中赎回费用的百分之二十计入基金资产。基金转换费用由基金持有人承担。

注：转出基金的申购费率高于转出基金的适用申购费率时，按转出申购费率计；即“申购费率补差费=转出基金的适用申购费率-转出基金的适用申购费率”；当转入基金的适用申购费率等于或低于转出基金的适用申购费率时，不收取申购费补差。

(7) 申购赎回费率公式为：
申购公式如下： $A = [B \times (1 - D)] / (1 + F) + E$
其中，A为申购金额，B为转出基金份额，C为赎回申请当日转出基金的基金份额净值，D为转出基金的对赎回费率的适用比例，E为申购补差费，F为申购费率。
赎回公式如下： $G = H \times I \times J / K$
其中，G为赎回金额，H为赎回份额，I为赎回申请当日转出基金的基金份额净值，J为赎回费率的适用比例，K为赎回费。
赎回费按持有时间长短实行分段计算（赎回费率为基金合同所约定的费率），具体赎回费率请参见招募说明书的约定。转出人的基金份额赎回资金在扣除赎回费用后，由该投资人产生的损失自行承担，上述赎回费产生的收益归基金管理人所有。
基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，调低上述申购费率、赎回费率，上述费率发生变更，基金管理人最迟于新的费率实施前30日至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。调整后的上述费率还将在今后的更新的招募说明书中披露。

(四) 其他费用

基金运作和销售过程中发生的其他费用, 以及因与本基金有关的其他费用, 将按照国家法律法规的规定, 予以收取和列支。

(五) 不列入基金费用的项目

1. 基金管理人和基金托管人未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失;
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。

(六)费用调整

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3日前在指定媒体上刊登公告。

(七)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、基金的保本

本基金持有到期基金份额的赎回费如下：在一个保本周期内赎回基金份额持有人一直持有到期保本份额未赎回的基金份额，在第一个保本周期结束后各保本周期赎回基金份额持有人于上一个保本周期结束后选择继续认购并转入当期保本周期并持有到期保本周期到期日的基金份额以及过赎回申购并持有到期保本周期到期日的基金份额

本基金基金份额持有人持有到期基金份额提供保本保障为以下几种情况：

2.1 本基金第一个保本周期基金份额持有人提供的保本金额为基金份额持有人以认购并持有到期基金份额的净认购金额、申购费及募集期间利息折入之收入之和

2.2 本基金第二个保本周期持有到期基金份额持有人提供的保本金额分为：一、保本周期赎回款项选择认购并持有到期保本周期到期日的基金份额以及过赎回申购并持有到期保本周期到期日的基金份额

基金份额持有人持有当期基金份额的基金份额的保本额,以及过渡期并持有到期当期基金份额到期的基金份额的保本额,分别以以下方式计算:

(1) 从上一保本周期选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期当期基金份额到期的基金份额持有人的保本额为:

保本额 = 基金份额持有人选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期当期基金份额到期的基金份额在基金份额折算日所代表的资产净值

(2) 过渡期并持有到期当期基金份额到期的基金份额持有人的保本额为:

保本额 = 基金份额持有人过渡期并持有到期当期基金份额到期的基金份额在基金份额折算日所代表的资产净值

在保本期间申购使用。如基金份额持有人持有到期前的基金份额净值乘以加上相应基金份额累计分红之和大于申购的资金额等于或小于保本金额，基金管理人将按照到期日基金份额净值计算的赎回金额予以支付给基金份额持有人。如基金份额持有人持有到期前的基金份额净值乘以加上相应基金份额累计分红之和大于申购的资金额低于保本金额，基金管理人应补足差额，并在保本期间到期前日或二十个工作日内（含第二十个工作日）将差额支付给基金份额持有人。但基金份额持有人持有到期前赎回或转出持有的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用保本条款。

（二）适用保本条款的情形

对于第 1 条基金合同约定的申购赎回费率，申购赎回费率在申购赎回当日并持有到期本周期的基金份额，以及基金份额持有人于本基金本周期限满 1 年后选择赎回当期并持有到期本周期的基金份额，以基金份额持有人于本基金本周期限满 1 年后选择赎回当期并持有到期本周期的基金份额的申购（赎回）费率，折减至零后的基金份额。

3 对于持有到期本周期的基金份额，基金份额持有人于本基金本周期限满 1 年后选择赎回，转换的基金份额管理人管理的其他基金，本基金除上述一下基金份额外均为“诺安策略精选股票型证券投资基金”，同样适用本条条款。

（3）不适用其他条款的情形

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人持有到期基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上应基金份额持有人计算申购费和赎回费的金额低于其基金份额。

- 3.基金份额持有人在基金定期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出基金份额；
- 4.基金份额持有人在当期保本周期内申购或赎回基金份额；
- 5.在保本周期发生本基金合同规定的基金合同终止的情形；
- 6.在保本周期到期日及本基金与其他基金合并或变更基金管理人情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
- 7.在保本周期到期日前（不包括该日）基金份额持有人任意的净赎回或净申购；
- 8.未经担保人书面同意修改基金合同条款，可能加重担保人的任何责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外；
- 9.因不可抗力因素导致基金投资亏损，或因不可抗力事件导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务，或因不可抗力因素导致基金的其他情形或管理人免于履行担保责任的情形。

(四) 本基金赎回期前基金净值的表现形式

假设本周期赎回前,符合本基金基金存续条件下,本基金基金净值继续并进入下一保本周期,新的保本周期的具体起始日期以基金管理人届时公告为准。

如按本基金赎回期前,本基金未符合上述本基金基金存续条件,则本基金将根据本合同的约定,变更为“诺安策略精选股票型证券投资基金”。同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及以基金份额持有人大会也将根据基金合同的约定予以相应调整。上述变更须经基金份额持有人和基金托管人同意,不可基金份额持有人大会决议,在股中国证券投资基金业协会,提前在指定公告或指定基金信息披露网站予以说明。

如本基金不符合上述条件及原因系本基金基金净值表现所致,则本基金将根据本基金合同的规定终止。

2. 本券发行前, 更新《根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规的有关规定, 对《基金合同》进行了修订, 对基金管理人于 2015 年 10 月 30 日发布的《关于本基金首次证券投资基金募集说明书进行了更新, 并拟根据基金管理人在本报告期内对本基金实施投资策略变动进行了更新说明的内容如下, 主要更新的内容如下:

3. 在“重要提示”部分, 更新了更新说明的内容截止日期及相关财务数据的截止日期。

4. 在“第二部分的释义”中, 更新了部分词语的含义。

5. 在“第三部分的基金管理人”中, 更新了证券投资基金管理情况。更新了基金情况。

6. 在“第四部分的基金托管人”中, 更新了基金托管部门主要人员情况, 基金托管业务经营情况的相关说明。

6. 在“第五节 相关服务机构”中,更新了销售机构名称及代销机构,并还注意基金的信息。

7. 在“第六节 基金合同的变更”中,更新了基金存续期内基金份额持有人数量及资产规模的信息。

8. 在“第八节 基金份额的申购与赎回”中,更新了基金份额的申购与赎回、基金的转换、基金的收益支付户的变更信息。

9. 在“第九节 基金合同的保全”中,更新了保本,适用保本条款的情形,不适用保本条款的情形,保本基金到期时的处理方案的相关信息。

10. 在“第十节 基金合同的终止”中,更新了基金合同第四点的内容,保证合同的主要内容,担保费用的费率及支付方式,基金到期前更换担保人,保本期间内增加担保人的相关信息。

10、在“第十一部分 基金投资”中,更新了保举近期所投资、变更后的“诺安策略精选股票型证券投资基金”投资,并“第六部分 基金投资组合”中,补充了本基金最近一期投资组合信息,相关数据及内容的截止日期为2015年3月31日。

11、在“第十二部分 基金业绩”中,更新了本基金基金合同生效以来的投资业绩。

12、在“第十四部分 基金资产的估值”中,更新了估值程序、估值方法、特殊情形的处理的信息。

13、在“第十六部分 基金的费用与税收”中,更新了与基金估值有关的信息。

14、在“第十八部分 基金的信息披露”中,新增了投后跟踪披露信息披露,更新了资产支持证券信息披露的内容。

15、在“第十九部分 基金的风险管理”中,终止了基金风险的披露,更新了资产支持证券、基金合同1)的变更的

16. 在“第二十一部分 基金合同内容摘要”中,更新了基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则、基金合同的变更、终止与基金财产清算的相关内容;

17. 在“第二十二部分 基金投资协议摘要”中,更新了基金托管协议当事人、基金托管人对基金管理人业务监督和核查的内容;

18. 在“第二十三部分 对基金份额持有人的服务”中,更新了“四、基金投资的服务”的内容;

19. 在“第二十四部分 其他应披露事项”中,列举了本基金在本报告期内的相关公告。

十六、签署日期
2015年5月28日

以上内容仅为摘要,须与本招募说明书(更新)正文所载之详细资料一并阅读。

诺安基金管理有限公司
2015年7月11日