

(上接 C99版)

5 报告期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

Table with 5 columns: 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(%)

6 报告期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

7 本报告期末未持有资产支持证券

8 本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

9 本报告期末未持有贵金属

10 本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

11 本报告期末未持有权证

12 本报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

13 本报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

14 本报告期末基金投资的期权交易情况说明

15 本报告期末基金投资的资产支持证券交易情况说明

16 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

17 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

18 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

19 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

20 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

21 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

22 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

23 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

24 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

25 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

26 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

27 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

28 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

29 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

30 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

31 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

32 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

33 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

34 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

35 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

36 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

37 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

38 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

39 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

40 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

41 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

42 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

43 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

44 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

45 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

46 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

47 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

48 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

49 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

50 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

51 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

52 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

53 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

54 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

55 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

56 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

57 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

58 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

59 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

60 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

61 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

62 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

63 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

64 本报告期末基金投资的衍生品交易情况说明

基金资产净值

但投资者购买本基金并不等于将资金存放在银行或在存款类金融机构，本基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金资产净值

的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在购买基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并仔细阅读基金合同中的风险提示部分。

本基金合同生效后，与同期基金的比较如下表所示：

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④

注：本基金合同生效日为2015年8月18日。

14.1 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. 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、仲裁费

5. 基金份额持有人大会费用

6. 基金证券、期货交易费用

7. 基金银行的银行费用

8. 基金相关账户的开户及维护费用

9. 按照国家有关规定在《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用

14.2 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

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，经基金管理人

与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起2-5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

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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，经基金管理人

与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起2-5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。

上述“14.1 基金费用的种类”中第3—9项费用，根据有关法规及相应合同约定，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。

14.3 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. 基金管理人处理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

14.4 费用调整

在法律法规规定的范围内，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、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，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前2日在指定媒介上公告。

14.5 基金收益

基金运作过程中涉及的各项税费，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

14.6 与基金合同有关的争议解决

1. 申购费用

本基金申购采用金额申购方式，申购费率如下表。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按笔计算。

Table with 2 columns: 申购金额(M), 申购费率

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等费用。

申购费的计算方法：申购费用=申购金额×申购费率

申购费用=申购金额-净申购金额

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点后3位开始舍去，舍去部分归基金财产。

2. 赎回费用

本基金的赎回费率按基金份额持有期限递减，费率如下：

Table with 2 columns: 持有期限(N), 赎回费率

(注：1.年指365天，2.年为730天，依此类推)

赎回费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点后3位开始舍去，舍去部分归基金财产。

赎回费用由赎回基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时自动扣除。

赎回费用在扣除相关费用后，余额归基金份额持有人所有，用于支付市场推广、销售、注册登记等费用。

对持续持有期少于30日且不少于7日的投资人收取1.5%的赎回费，并将赎回费总额的25%计入基金财产；对持续持有期少于3个月且不少于7日的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资者收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的100%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的100%计入基金财产。

5 报告期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

基金资产净值

但投资者购买本基金并不等于将资金存放在银行或在存款类金融机构，本基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金资产净值

的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在购买基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并仔细阅读基金合同中的风险提示部分。

本基金合同生效后，与同期基金的比较如下表所示：

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④

注：本基金合同生效日为2015年8月18日。

14.1 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. 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、仲裁费

5. 基金份额持有人大会费用

6. 基金证券、期货交易费用

7. 基金银行的银行费用

8. 基金相关账户的开户及维护费用

9. 按照国家有关规定在《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用

14.2 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

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，经基金管理人

与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起2-5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

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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，经基金管理人

与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起2-5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。

上述“14.1 基金费用的种类”中第3—9项费用，根据有关法规及相应合同约定，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。

14.3 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. 基金管理人处理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

14.4 费用调整

在法律法规规定的范围内，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、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，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前2日在指定媒介上公告。

14.5 基金收益

基金运作过程中涉及的各项税费，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

14.6 与基金合同有关的争议解决

1. 申购费用

本基金申购采用金额申购方式，申购费率如下表。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按笔计算。

Table with 2 columns: 申购金额(M), 申购费率

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等费用。

申购费的计算方法：申购费用=申购金额×申购费率

申购费用=申购金额-净申购金额

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点后3位开始舍去，舍去部分归基金财产。

2. 赎回费用

本基金的赎回费率按基金份额持有期限递减，费率如下：

Table with 2 columns: 持有期限(N), 赎回费率

(注：1.年指365天，2.年为730天，依此类推)

赎回费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点后3位开始舍去，舍去部分归基金财产。

赎回费用由赎回基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时自动扣除。

赎回费用在扣除相关费用后，余额归基金份额持有人所有，用于支付市场推广、销售、注册登记等费用。

对持续持有期少于30日且不少于7日的投资人收取1.5%的赎回费，并将赎回费总额的25%计入基金财产；对持续持有期少于3个月且不少于7日的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资者收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的100%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的100%计入基金财产。

基金资产净值

但投资者购买本基金并不等于将资金存放在银行或在存款类金融机构，本基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金资产净值

的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在购买基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等法律文件，并仔细阅读基金合同中的风险提示部分。

本基金合同生效后，与同期基金的比较如下表所示：

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差, ①-②, ③-④

注：本基金合同生效日为2015年8月18日。

14.1 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. 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、仲裁费

5. 基金份额持有人大会费用

6. 基金证券、期货交易费用

7. 基金银行的银行费用

8. 基金相关账户的开户及维护费用

9. 按照国家有关规定在《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用

14.2 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

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，经基金管理人

与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起2-5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

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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，经基金管理人

与基金托管人核对一致后，由基金托管人复核后于次月首日起2-5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。

上述“14.1 基金费用的种类”中第3—9项费用，根据有关法规及相应合同约定，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。

14.3 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. 基金管理人处理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

14.4 费用调整

在法律法规规定的范围内，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、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，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前2日在指定媒介上公告。

14.5 基金收益

基金运作过程中涉及的各项税费，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

14.6 与基金合同有关的争议解决

1. 申购费用

本基金申购采用金额申购方式，申购费率如下表。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按笔计算。

Table with 2 columns: 申购金额(M), 申购费率

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等费用。

申购费的计算方法：申购费用=申购金额×申购费率

申购费用=申购金额-净申购金额

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点后3位开始舍去，舍去部分归基金财产。

2. 赎回费用

本基金的赎回费率按基金份额持有期限递减，费率如下：

Table with 2 columns: 持有期限(N), 赎回费率

(注：1.年指365天，2.年为730天，依此类推)

赎回费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点后3位开始舍去，舍去部分归基金财产。

赎回费用由赎回基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时自动扣除。