（上接B42版）

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人：杨懿
联系人：张燕
联系电话：010-58325388-1588
业务传真：010-58325282
客服热线：400-166-1188
公司网址：http://8.jrj.com.cn
（75）名称：大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
联系电话：0351-4130322
业务传真：0351-4137986
客服热线：4007121212
公司网址：www.dtsbc.com.cn
（76）名称：北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁越
联系人：陈攀
联系电话：010-57756019
业务传真：010-57756199
客服热线：400-786-8868-5
公司网址：www.chtfund.com
（77）名称：爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：钱华
联系人：王薇
联系电话：021-32229888
业务传真：021-68728703
客服热线：4001-962502
公司网址：www.ajzq.com
（78）名称：嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：景琪
电话：021-20289890
传真：021-20280110
网址：www.harvestwm.cn
客服电话：400-021-8850
（79）名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
联系电话：010-52855713
业务传真：010-85894285
客服热线：400-6099-200
公司网址：www.yixinfund.com
（80）名称：中经北证（北京）资产管理有限公司
公司简称：中经北证
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人：徐福星
联系人：陈莹莹
联系电话：13261320700
业务传真：010-88381550
客服热线：010-68998820
公司网址：www.bzfunds.com
（81）名称：一路财富(北京)信息科技有限公司
公司简称：一路财富
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
联系电话：010-88312877-8009
业务传真：010-88312099
客服热线：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com
（82）名称：中经北证（北京）资产管理有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲129号新华1949产业园东门
法定代表人：徐福星
联系人：陈莹莹
联系电话：13261320700
业务传真：010-88381550
客服热线：010-68998820
公司网址：www.bzfunds.com
（83）名称：厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人：林松
联系人：李智磊
联系电话：0592-3122679
业务传真：0592-8060771
客服热线：0592-3122731
公司网址：www.xds.com.cn
（84）名称：中信建投期货有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
联系人：刘芸
联系电话：023-86769637
业务传真：023-86769629
客服热线：400-8877-780
公司网址：www.cfc108.com.cn
（85）名称：海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼
法定代表人：刘惠
联系人：刘艳妮
联系电话：021-80133827
业务传真：021-80133413
客服热线：400-808-1016
公司网址：www.fundhaiyin.com
（86）名称：北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：翟飞飞
联系电话：010-52703350-6006
业务传真：010-62020355
客服热线：4008886661
公司网址：www.myfund.com
（87）名称：上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
联系人：张裕
联系电话：15801816961
客服热线：4000676266
公司网址：www.leadfund.com.cn
3、其他代销机构
本基金发售期间，若新增代销机构或代销机构新增营业网点，则另行公告。
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
二、注册登记人
名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
法定代表人：王志伟
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31－33楼
电话：020-89188970
传真：020-89899175
联系人：李尔华
三、出具法律意见书的律师事务所
名称：国浩律师（广州）事务所
住所：广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人：程秉
电话：020－38799345
传真：020－38799335
经办律师：黄贞、陈桂华
联系人：程秉
四、审计基金资产的会计师事务所
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表：卢伯卿
联系人：洪锐明
电话：021－61418888
传真：021－63350003
经办注册会计师：郭新华、洪锐明

第四部分 基金的名称

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

第五部分 基金的类型

混合型发起式证券投资基金。

第六部分 基金的投资目标

本基金追求长期稳定的绝对收益。在有效控制系统性风险的基础上，通过量化模型构建市场中性投资组合，对冲市场系统风险，力争实现超越业绩比较基准的绝对收益。

第七部分 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股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债等）、权证、货币市场工具、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。
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。

第八部分 基金的投资策略

一、投资策略
本基金主要采用对冲套利的投资策略，坚持模型驱动的纪律性，运用基金管理人自主研发的量化多因素选股模型，选取具备投资价值的股票构建投资组合，并做空股指期货进行对冲操作，有效的规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益，力争实现基金资产长期稳健的增值。
（一）股票投资策略
本基金采用量化选股的方法，利用基金管理人自主研发的量化多因素选股模型进行股票投资价值定量分析，并在此基础上构建股票投资组合。在实际管理运作中，基金管理人将紧密跟踪模型的有效性和市场环境，及时对模型进行定期或不定期的修正，以降低投资风险。
本基金采用的量化选股模型建立在海外市场上广泛应用的多因素量化选股模型框架的基础之上，针对国内A股市场的实际情况，通过对中国市场运作规律的长期研究以及对大量历史数据的统计分析和实证检验，开发出的更具备本土适应性和有效性的A股量化选股模型。该模型按照对股票超额收益的区分能力、解释强度和稳健度为目标，从多个维度构建定量分析指标，包括估值水平、成长能力、盈利能力、分析师预期、市场因素等五大类指标。
具体来讲，估值水平指标包含静态、动态的市盈率、市净率、市销率等；成长能力指标主要包括长期主营业务收入增长率、长期利润增长率等；盈利能力指标主要包括净资产收益率、主营业务利润率、资产净利率等；分析师预期指标主要考虑股票评级的变动情况以及盈利预测的变动情况等；市场因素指标主要包括技术面和动量反转类等指标。
（二）股指期货对冲策略
在通过以上的量化多因素模型进行选股、构建股票组合的基础上，本基金利用优化程序对个股的权重进行优化配置，以提高股票投资组合与股指期货的价格走势的相关性，然后通过卖空股指期货对冲组合的系统性风险，从而分离出组合的超额收益。
具体来讲，根据完全套保的原则，首先通过股票投资组合的市值计算卖空股指期货合约的数量；然后综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性以及保证金要求等各种因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。
本基金做空的股指期货合约价值与股票投资组合的市值相匹配，权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在90%－110%之间，从而基本上保持市场中性。
（三）事件驱动套利策略
事件驱动策略投资于发生特殊事件或转变时能带来超额收益的股票，例如发生高送转、定向增发、ETF指数基金定期调样等事件。通过定量分析，该类事件的发生会大概率引起证券价格的短期波动，通过买入事件驱动的股票，获得低风险下的投资收益。主要有以下几类：
1、指数成分调整套利策略
在指数每年两次的成份股调整期间，根据需要调入指数的股票相对于指数一般有更好的表现这一特征，在调整实施日前提前买入需要调入的股票，从而获得超额收益。
2、股指期货基差套利策略
利用股指期货与股票现货指数之间价差（通常称为基差）的运行规律，在期货价格高出指数现货价格一定范围时，买入现货指数成分股（或者ETF），并同时做空期货对冲，等基差收敛时再卖掉股票现货（或者ETF）、平掉期货实现收益。
3、可转债转股套利策略
在可转换债券的转换期间内，由于未来股价涨跌具有不确定性，当可转换债券或股票交易波动较大时，可能出现可转换债券与正股之间存在套利机会的现象或者出现可转换债券流动性暂时不足的现象，采用可转换债券转股策略，即：将持有的可转换债券在转换期内转股抛售以获得套利收益，实现可转换债券投资收益最大化。
（四）其他投资策略
1、债券投资策略
在债券投资上，本基金将坚持稳健投资原则，对各类债券品种进行配置。本基金将通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较，发现和确认市场失衡，把握投资机会；在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下，为投资者获得稳定的收益。
2、中小企业私募债投资策略
本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。
3、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。
根据有关规定，本基金投资权证遵循下述投资比例限制：
1）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
2）本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的百分之三。
3）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。
若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。
二、投资决策依据和投资程序
（一）投资决策依据
1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2、宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。
（二）投资决策程序
1、投资决策委员会制定整体投资战略。
2、研究发展部根据自身或者其他研究机构的研究成果，构建股票备选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股决策支持；固定收益部债券研究小组提供债券研究支持。
3、基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略，根据投研联席会议的决议，结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟订所辖基金的具体投资计划，包括：资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。
4、投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。
5、根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由中央交易部执行。
6、中央交易部按相关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理小组。
7、监察稽核部的绩效评估与风险管理小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险，定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

第九部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：1年期银行定期存款税后收益率。
本产品定位为追求绝对收益回报的基金产品，因此采用上述业绩比较基准。
如果相关法律法规发生变化，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，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

第十部分 风险收益特征

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

第十一部分 基金投资组合报告

广发基金管理有限公司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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8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2015年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
1、期末基金资产配置组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	242,375,714.18	24.50
	其中：股票	242,375,714.18	24.50
2	固定收益投资	27,608.90	0.00
	其中：债券	27,608.90	0.00
	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	719,956,859.24	72.77
7	其他各项资产	27,044,880.03	2.73
8	合计	989,405,062.35	100.00

2、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	630,780.61	0.07
B	采矿业	8,183,903.40	0.95
C	制造业	102,013,866.71	11.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,995,713.46	2.09
E	建筑业	9,986,679.31	1.16
F	批发和零售业	5,872,773.65	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	11,945,270.30	1.39
H	住宿和餐饮业	32,780.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,533,531.84	0.87
J	金融业	53,799,337.40	6.24
K	房地产业	9,815,447.24	1.14
L	租赁和商务服务业	2,162,644.90	0.25
M	科学研究和技术服务业	2,998,254.04	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	389,565.00	0.05
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	7,496,401.32	0.87
S	综合	1,518,765.00	0.18
	合计	242,375,714.18	28.10

3、期末基金投资前十名股票

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	600036	招商银行	616,476	11,540,430.72	1.34
2	600000	浦发银行	629,900	10,683,104.00	1.24
3	601318	中国平安	107,100	8,775,774.00	1.02
4	600048	保利地产	427,262	4,879,332.04	0.57
5	600886	国投电力	307,500	4,572,525.00	0.53
6	601668	中国建筑	545,000	4,528,950.00	0.53
7	002415	海康威视	97,500	4,368,000.00	0.51
8	600038	中直股份	68,200	4,224,990.00	0.49
9	002353	杰瑞股份	85,700	3,800,795.00	0.44
10	601166	兴业银行	220,200	3,798,450.00	0.44

4、期末按券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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	27,608.90	0.00
8	其他	-	-
9	合计	27,608.90	0.00

5、期末债券投资前五名组合

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	110031	航信转债	190	27,608.90	0.00

6、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资产支持证券投资明细
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序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1507	IF1507	175.00	-229,782,000.00	7,051,937.96	-
公允价值变动总额合计(元)					7,051,937.96
股指期货投资本期收益(元)					-219,234,035.84
股指期货投资本期公允价值变动(元)					55,003,455.84

（2）本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货以套期保值主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本基金本报告期末未持有国债期货。
（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。
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在本报告期内没有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）报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	26,962,197.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	82,682.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,044,880.03

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末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。

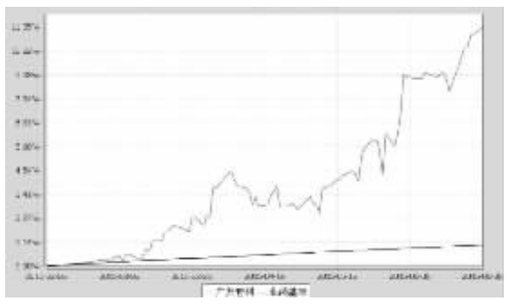
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600886	国投电力	4,572,525.00	0.53	重大事项
2	002353	杰瑞股份	3,800,795.00	0.44	重大事项

第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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。基金业绩数据截至2015年6月30日。
（一）净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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)
2015.2.6-2015.6.30	11.40%	0.48%	0.99%	0.00%	10.41%	0.48%
自基金合同生效起至今	11.40%	0.48%	0.99%	0.00%	10.41%	0.48%

（二）本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图
广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年2月6日至2015年6月30日)



注：（1）本基金合同生效日期为2015年2月6日，至披露时点本基金成立未满一年。
（2）本基金建仓期为基金合同生效后6个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

第十三部分 基金的费用

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、证券账户开户费用和银行账户维护费；
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。
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
基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：
（1）基金管理人的基本管理费
本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1%÷当年天数
H为每日应计提的基金基本管理费
E为前一日的基金资产净值
基金基本管理费每日计算，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基本管理费划款指令，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）基金管理人的附加管理费
1）基金管理人可在满足以下条件的前提下，提取附加管理费：
附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“断高法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费；即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。提取评价日是每次基金封闭期的最后一个工作日。
2）附加管理费的计算方法和提取
在满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：
附加管理费=[P(a)-P(h)]*10%*S(a)
其中：
P(a)：提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值
P (a)=提取评价日基金份额净值*提取评价日的折算因子，其中n为累计分红次数
P(h)：以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1 的孰高者，其中首次封闭期的P(h)为1
S(a)：提取评价日的基金份额=提取评价日基金总份额;提取评价日的折算因子
特定日期的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积
折算系数=基金折算日除权前基金份额净值÷基金折算日除权后基金份额净值
附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。由基金管理人向基金托管人发送基金附加管理费划款指令，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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.2%÷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。
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
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、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和基金托管费等相关费率。
调低基金管理费率和基金托管费率等费率，无需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个工作日在至少一种指定媒体上公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》的内容进行了更新，主要更新的内容如下：
1. 在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。
2、在“第四部分 基金托管人”部分，根据基金托管人人员变动及业务经营情况对基金托管人信息进行了相应更新。
3、在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了相关的代销机构，对原有销售机构的资料进行更新，相关事宜均已公告。
4、在“第九部分 基金的投资”部分，更新了截至2015年6月30日的基金投资组合报告。
5、在“第十部分 基金的业绩”部分，更新了截至2015年6月30日的基金业绩。
6、在“第十一部分 基金资产的估值”部分，对原有估值方法进行更新，相关事宜均已公告。
7、根据最新公告，对“第二十二部分 其他应披露事项”内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一五年九月十六日

证券代码：002705 证券简称：新宝股份 公告编码：（2015）046号

广东新宝电器股份有限公司关于注销募集资金专用账户的公告

广东新宝电器股份有限公司（以下简称“新宝股份”、“公司”或“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、误导性陈述或者重大遗漏。

一、募集资金基本情况
经中国证券监督管理委员会“证监许可［2013]1652号”《关于核准广东新宝电器股份有限公司首次公开发行股票的批复》核准，并经深圳证券交易所同意，公司向社会公开发行人民币普通股7,600万股，每股发行价格为10.50元，募集资金总额为人民币798,000,000元，扣除发行费用62,843,042.78元，实际募集资金净额为人民币735,156,957.22元。以上募集资金已由立信会计师事务所（特殊普通合伙）于2014年1月14日出具的信会师报字[2014]第410005号《验资报告》验证确认。
二、募集资金存放和管理情况
（一）募集资金管理情况
为规范募集资金的管理和使用，方便募集资金投资项目的建设，根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等法律、法规和规范性文件的规定，公司依据实际情况，分别在广东顺德农村商业银行股份有限公司勒流支行、招商银行股份有限公司佛山顺德支行、中国工商银行股份有限公司佛山顺德勒流支行、中国光大银行股份有限公司佛山顺德支行、中国进出口银行广东省分行五家银行开立募集资金专用账户，用于存放和管理全部募集资金。公司已于2014年2月12日与保荐机构东莞证券股份有限公司（以下简称“东莞证券”）及上述五家银行分别签订了《募集资金专户存储三方监管协议》。
为了进一步加强募集资金管理，提高资金使用效率和存储收益，公司2015年8月24日召开的第四届董事会第四次会议审议通过了《关于增加募集资金专户并签订募集资金三方监管协议的议案》，同意公司将在永亨银行（中国）有限公司佛山支行开立的用于暂时闲置的蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金购买银行理财产品的专用结算账户增设为蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金专项账户，账号为：3401712158003，该专户仅用于公司蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金的存储和使用，不得用作其他用途。现有蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金专户（中国进出口银行广东省分行，账号215000010000145555），公司将在其投资产品（6个月定期存款）2015年9月9日到期后，把该专户的资金余额转到永亨银行（中国）有限公司佛山支行专户进行专项存储，并注销公司在中国进出口银行广东省分行开立的募集资金专户。
公司已于2015年8月24日与东莞证券及永亨银行（中国）有限公司佛山支行签订了《募集资金专户存储三方监管协议》。
上述监管协议主要条款与深圳证券交易所三方监管协议范本不存在重大差异。截至本公告日，募集资金三方监管协议得到了切实有效的履行。
（二）募集资金存放情况
截止2015年8月31日，公司募集资金的存储金额为328,767,210.06元，专户存储情况如下：

账户名称	开户银行	银行账号	募集资金余额	备注
本公司	中国光大银行股份有限公司佛山顺德支行	38810188000030660	5,284,089.07	活期
		38810181000020437	40,000,000.00	定期存款
		38810181000022061	20,000,000.00	定期存款
		38810181000022143	20,000,000.00	定期存款
		小计	85,284,089.07	
本公司	招商银行股份有限公司佛山顺德支行	757900014810799	2,953,783.48	活期
		757900014881000020	15,000,000.00	定期存款
		757900014881000016	40,000,000.00	定期存款
		小计	57,953,783.48	
本公司	中国进出口银行广东省分行	215000010000145555	11,514,346.42	活期
		215000010000147882	70,000,000.00	定期存款
		小计	81,514,346.42	
本公司	广东顺德农村商业银行股份有限公司勒流支行	801101000540406154	4,788,131.58	活期
		801102000619528314	18,000,000.00	定期存款
		小计	22,788,131.58	
本公司	中国工商银行股份有限公司佛山顺德勒流支行	2013031362920105458 8	6,226,159.51	活期
		/	45,000,000.00	工商银行 理财产品
		小计	51,226,159.51	
本公司	永亨银行（中国）有限公司佛山支行	3401712158003	700.00	活期
		/	30,000,000.00	永亨银行 理财产品
		小计	30,000,700.00	
合计			328,767,210.06	

三、本次注销的募集资金专户的情况
（一）募集资金专户基本情况
开户名称：广东新宝电器股份有限公司
开户银行：中国进出口银行广东省分行
账 号：215000010000145555
（二）募集资金专户存储情况
2014年1月15日，公司将首次公开发行股票所募集资金中的人民币15,429万元存入中国进出口银行广东省分行募集资金专户，账号为215000010000145555，该专户仅用于公司蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金的存储和使用，不得用作其他用途。
（三）募集资金专户使用情况
1、2014年2月27日，公司第三届董事会第十五次临时会议审议通过了《关于以募集资金置换预先已投入募集资金投资项目自筹资金的议案》，同意公司以募集资金置换预先已投入募集资金投资项目的部分自筹资金，蒸汽压力型咖啡机技术改造项目置换金额合计465.14万元，该款项已于2014年3月5日置换完成。
2、公司2015年4月24日召开的第四届董事会第二次会议和2015年5月18日召开的2014年年度股东大会，审议通过了《关于使用闲置募集资金和自有资金进行现金管理的议案》，同意公司在确保不影响公司正常经营、募投项目建设的前提下，使用不超过33,000万元额度的闲置募集资金进行现金管理，投资安全性高、流动性好、有保本约定的投资产品，在此限额内资金额度可滚动使用。
根据现行法律、法规及公司《募集资金管理办法》的相关规定，公司于2015年6月16日在永亨银行（中国）有限公司佛山支行开立了专用结算账户，开户名称为广东新宝电器股份有限公司，账号为3401712158003。该账户专门用于暂时闲置的蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金购买银行理财产品购买银行理财产品的结算，不得存放非募集资金或用作其他用途。
公司于2015年6月17日从中国进出口银行广东省分行募集资金专户转出3,000万元到永亨银行（中国）有限公司佛山支行专用结算账户，并于2015年6月19日购买了永亨银行6个月保本型银行理财产品。
截止2015年6月30日，公司中国进出口银行广东省分行募集资金专户用于现金管理的募集资金余额为10,000万元。其中，用于办理定期存款的募集资金余额为7,000万元，用于购买银行理财产品的募集资金余额为3,000万元。
3、为了进一步加强募集资金管理，提高资金使用效率和存储收益，公司2015年8月24日召开的第四届董事会第四次会议审议通过了《关于增加募集资金专户并签订募集资金三方监管协议的议案》，同意公司将在永亨银行（中国）有限公司佛山支行开立的用于暂时闲置的蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金购买银行理财产品的专用结算账户增设为蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金专项账户，账号为：3401712158003，该专户仅用于公司蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金的存储和使用，不得用作其他用途。现有蒸汽压力型咖啡机技术改造项目募集资金专户（中国进出口银行广东省分行），公司将在其投资产品到期后，把该专户的资金余额转到永亨银行（中国）有限公司佛山支行专户进行专项存储，并注销公司在中国进出口银行广东省分行开立的募集资金专户。
2015年9月9日，中国进出口银行广东省分行的7,000万元定期存款已全部到期。
截至2015年9月14日转出前，中国进出口银行广东省分行募集资金专户余额为人民币82,280,593.36元（包括累计收到的银行存款利息扣除银行手续费等的净额）。
（四）募集资金专户注销情况
公司已于2015年9月14日将中国进出口银行广东省分行募集资金专户（账号：215000010000145555）余额82,280,383.36元（扣除手续费210元）转到永亨银行（中国）有限公司佛山支行专户（账号：3401712158003）进行专项存储，并按相关规定办理了中国进出口银行广东省分行募集资金专户注销手续。
上述募集资金专户注销后，公司及保荐机构东莞证券与中国进出口银行广东省分行共同签订的《募集资金专户存储三方监管协议》相应终止。
特此公告！

广东新宝电器股份有限公司
董事会
2015年9月16日

股票简称：韶能股份 股票代码：000601 编号：2015-040

广东韶能集团股份有限公司发行股份购买资产进展情况公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任

广东韶能集团股份有限公司（下称"公司"）、公司第二大股东韶关市工业资产有限公司均正在筹划重大事项，公司拟通过发行股份方式购买资产，该事项构成重组。鉴于该事项存在不确定性，经公司申请，公司股票已于2015年8月18日上午开市起停牌，具体见公司于2015年8月18日在《证券时报》、巨潮资讯网上刊登的《关于重大事项的停牌公告》。
截至目前，公司本次筹划发行股份购买资产事项相关情况及进展如下：
一、基本情况介绍
公司拟通过非公开发行股份购买资产的方式收购相关标的公司股权。
公司本次拟收购交易标的有两个，一个是专业从事智能控制、物联网、智能传感网软硬件一体化平台解决方案的国家级高新技术企业；另一个是专业从事互联网金融和互联网金融服务