海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告

海富通基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下基金所持有的上海家化(股票代码600315)、碧水源(股票代码300070)因重大事项连续停牌。根据中国证监会2008年9月12日下发的[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》及本公司停牌股票的估值政策和程序,经和托管人协商,本公司决定自2015年10月12日起采用“指数收益法”对本公司旗下基金所持有的上述股票进行估值。敬请投资者予以关注。

待上述股票其交易体现了活跃市场交易特征后,本公司将恢复采用当日收盘价格进行估值,届时不再另行公告。

特此公告。

海富通基金管理有限公司

2015年10月13日

海富通现金管理货币市场基金清算报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

律师事务所:上海市通力律师事务所

报告送出日期:2015年10月13日

一、重要提示

海富通现金管理货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1540号文核准募集,于2013年3月13日成立并正式运作,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为保护基金份额持有人的利益,基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据《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》和《海富通现金管理货币市场基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,提议终止《基金合同》。

本基金的基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会投票表决起止时间为2015年6月25日起至2015年7月20日24:00止。2015年7月21日,在本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司授权代表的监督下,基金管理人对本次大会表决进行了计票,上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证,上海市东方公证处对计票过程及结果进行了公证。会议表决通过了《关于终止海富通现金管理货币市场基金基金合同有关事项的议案》,决定终止《基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见刊登在2015年7月22日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站(http://www.hftfund.com)上的《海富通基金管理有限公司关于海富通现金管理货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金从7月23日起进入清算期,由基金管理人海富通基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称:海富通现金管理货币市场基金(基金简称:海富通现金管理货币,基金代码:海富通现金管理货币A 519528;海富通现金管理货币B 519529)

2、基金运作方式:契约型开放式

3、基金合同生效日:2013年3月13日

4、2015年7月23日基金份额总额:1,926,300.70份。

5、投资目标:在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的收益。

6、投资策略:本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,力求将各类风险降到最低,在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。

7、业绩比较基准:七天通知存款利率(税后)

8、风险收益特征:本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

9、基金管理人:海富通基金管理有限公司

10、基金托管人:中国工商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2012】1540号文核准,由基金管理人海富通基金管理有限公司自2013年2月25日起至2013年3月8日向社会公开发行募集,基金合同于2013年3月13日正式生效,首次设立募集规模为1,101,186,692.48份基金份额。自2013年3月13日至2015年7月23日期间,本基金按基金合同正常运作。

为适应市场环境变化,保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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》和《基金合同》的有关规定,提议终止《基金合同》。本基金的基金份额持有人大会于2015年6月25日起至2015年7月20日24:00以通讯方式召开,会议审议并通过了《关于终止海富通现金管理货币市场基金基金合同有关事项的议案》,决定终止《基金合同》。本基金从2015年7月23日起进入清算期。

四、财务报表

经审计的资产负债表

会计主体:海富通现金管理货币

报告截止日:2015年7月23日

单位:人民币元 资 产	最后运作日 2015年7月23日
资 产:	
银行存款	1,873,846.72
结算备付金	113,333.33
应收利息	1,318.11
资产总计	1,988,498.16
负 债:	
应付管理人报酬	1,343.94
应付托管费	465.38
应付销售服务费	421.69
应付利润	1,910.49
其他负债	58,055.96
负债合计	62,197.46
所有者权益:	
实收基金	1,926,300.70
未分配利润	-
所有者权益合计	1,926,300.70
负债和所有者权益总计	1,988,498.16

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定,清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况,从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

2、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额(单位:人民币元)
一、2015年7月23日所有者权益	1,926,300.70
加:清算期间净收益	255.48
加:应付利润未结转余额	1,910.49
二、2015年7月29日所有者权益	1,928,466.67

本基金清算期为自2015年7月23日至2015年7月29日,资产处置及负债清偿后,截至2015年7月29日,本基金剩余财产为人民币1,928,466.67元,根据本基金的《基金合同》约定,依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算小组决定于2015年10月14日将基金剩余财产划出托管户进行分配。自2015年7月30日至2015年10月13日之间的利息归份额持有人所有,期间应收利息以当前适用的利率预估为3,000.23元。

基金管理人将以自有资金垫付应收利息,并于2015年10月14日划入托管账户,基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于托管账户销户后返还给基金管理人。

3、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核,在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1)海富通现金管理货币市场基金2015年7月23日(基金最后运作日)资产负债表及清算审计报告

(2)关于《海富通现金管理货币市场基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

海富通现金管理货币市场基金财产清算小组

2015年7月29日

证券代码:002353 证券简称:杰瑞股份 公告编号:2015-078

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动情况

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司(以下简称"公司"或"杰瑞股份")股票(股票简称:杰瑞股份,股票代码:002353)交易价格连续2个交易日内(2015年10月9日、2015年10月12日)收盘价格跌幅偏离值累计达到20%以上,根据《深圳证券交易所交易规则》的有关规定,属于股票交易异常波动的情形。

二、公司关注并核实相关情况

针对公司股票异常波动,公司就相关事项进行了必要核实,现将有关核实情况说明如下:

1、2015年9月30日公司披露了《关于终止筹划发行股份购买资产事项暨股票复牌的公告》(公告编号:2015-076),因标的公司尽职调查结果与拟交易价格存在较大背离,双方未能就合作条款和交易条件达成一致。从保护全体股东利益出发,经慎重考虑公司决定终止筹划本次发行股份购买资产事项。

2、公司近期生产经营情况正常,内外部经营环境未发生重大变化。

3、公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

4、公司未发现近期公共传媒报道了可能或已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息。

5、经核实,除以上事项外,公司及控股股东、实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项,也不存在处于筹划阶段的重大事项。

6、经查询,公司控股股东和实际控制人在股票交易异常波动期间不存在买卖公司股票的情形。

三、维护股价稳定方案

2015年7月9日、7月11日公司披露了《关于公司部分董事、高级管理人员股票增持计划的公告》、《关于维护公司股价稳定方案的公告》。

1、公司董事、总经理王继丽女士,副总经理李志勇先生基于对公司未来发展前景的信心,增强投资者对公司的信心,自2015年7月9日起的六个月内,通过证券公司、基金管理公司定向资产管理等方式增持不少于其2015年上半年累计减持股票金额的10%,并且承诺在增持计划完成后6个月内不减持公司股票。

2、公司大股东、董事、监事、高级管理人员将积极响应中国证监会的【2015】18号文号召,承诺自2015年7月11日起6个月内不通过二级市场减持公司股票。

3、公司将根据公司股票复牌后的走势,在法律、法规允许的范围内,建议公司员工增持公司股票,推动"奋斗者2号"员工持股计划的实施。

4、公司将积极利用电话咨询、现场调研、互动平台交流等方式,与投资者保持良好的沟通,介绍公司的生产经营情况,公司管理层对油服行业及公司未来发展的展望、分析,积极回答投资者的提问,及时澄清市场上关于公司的虚假负面信息,增加投资者对上市公司的理解与信心。

5、公司将一如既往踏踏实实、诚信经营、规范运作,切实提高企业发展质量,增加公司的核心竞争力,充分利用国内一带一路、油气改革等举措,积极提升公司治理和管理水平,完善公司内控制度,不断提高公司核心竞争力、盈利能力和全面风险管理能力。

四、是否存在应披露而未披露信息的说明

本公司董事会确认,本公司目前没有任何根据深交所《股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等;董事会也未获悉本公司有根据深交所《股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的、对本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

五、风险提示

1、经自查,本公司不存在违反信息公平披露的情形。

2、公司正在积极推动稳定股价措施决策和实施流程,具体实施日期公司将依据相关规定及时履行信息披露义务。

3、公司在2015年7月31日披露的《2015年半年度报告》中预计2015年1-9月归属于上市公司股东的净利润为10,383.85万元至31,151.54万元。

4、公司提醒广大投资者:公司指定信息披露媒体为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn),公司所有信息均以在上述指定媒体刊登的信息为准,敬请广大投资者理性投资,注意风险。

特此公告。

烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司

董事会

2015年10月12日

证券代码:002424 证券简称:贵州百灵 公告编号:2015-105

贵州百灵企业集团制药股份有限公司 关于全资子公司收到《医疗机构制剂调剂使用批件》的公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整,公告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

风险提示:该批复对公司经营业绩的影响暂无法估计,短期不会对公司的业绩产生重大影响。敬请投资者理性投资,注意投资风险。

贵州百灵企业集团制药股份有限公司(以下简称"公司")全资子公司贵州百灵中医糖尿病医院有限责任公司(以下简称:"中医糖尿病医院")近日收到贵州省食品药品监督管理局下发的《医疗机构制剂调剂使用批件》(批件号分别为"2015104"、"2015105"、"2015106"、"2015110"),根据《医疗机构制剂注册管理办法(试行)》及有关规定,兹批准以下医疗机构制剂按如下批准事项调剂使用。

一、批件号为"2015104"的《医疗机构制剂调剂使用批件》

制剂名称:糖宁通络胶囊

剂型:胶囊剂

批准文号:黔药制字Z20140033

调剂数量:1000盒/月

使用范围:中国贵航集团三0二医院

使用期限:6个月

有效期限:本批件2016年2月28日前一次性使用

贵航集团三0二医院位于安顺市经济技术开发南马大道,是隶属于中航医疗产业管理有限公司的一所国家三级乙等综合医院;是国际紧急救援中心网络医院、国家级"爱婴医院"、安顺市农合、医保定点医院;是遵义医学院非直属附属医院,遵义医学院、贵阳医学院教学医院,上海浦南医院协作医院。

二、批件号为"2015105"的《医疗机构制剂调剂使用批件》

制剂名称:糖宁通络胶囊

剂型:胶囊剂

批准文号:黔药制字Z20140033

调剂数量:1000盒/月

使用范围:安顺市西秀区虹山人民医院

使用期限:6个月

有效期限:本批件2016年3月16日前一次性使用

安顺市西秀区虹山人民医院位于安顺市西秀区中华东路中段,是市区两级城镇医疗保险定点医疗机构。

三、批件号为"2015106"的《医疗机构制剂调剂使用批件》

制剂名称:糖宁通络胶囊

剂型:胶囊剂

批准文号:黔药制字Z20140033

调剂数量:500盒/月

使用范围:贵阳市云岩区东山社区卫生服务站

使用期限:6个月

有效期限:本批件2016年3月8日前一次性使用

贵阳市云岩区东山社区卫生服务站位于贵阳市云岩区仙人洞路,是贵阳市云岩区中东社区卫生服务中心在东山管委会建立的卫生服务站,是一所集医疗、预防、保健、老年康复、健康教育、计划生育指导、基层卫生监督等七位于一体的综合性社区卫生机构。

四、批件号为"2015110"的《医疗机构制剂调剂使用批件》

制剂名称:糖宁通络胶囊

剂型:胶囊剂

批准文号:黔药制字Z20140033

调剂数量:1000盒/月

使用范围:贵阳市云岩区中东社区卫生服务中心

使用期限:6个月

有效期限:本批件2016年3月24日前一次性使用

贵阳市云岩区中东社区卫生服务站位于贵阳市云岩区宝山北路,是一所集医疗、预防、保健、老年康复、健康教育、计划生育指导、基层卫生监督等七位于一体的综合性社区卫生机构。健康管理人口达2万余人。所管居委会有宝山、东山、达兴、王家桥、警苑居委会等。

糖宁通络胶囊被批准在以上四所医疗机构调剂使用,扩大了该制剂适用的医疗机构数量,为广大糖尿病患者提供了更加方便的就医渠道。结合临床研究的开展,中医糖尿病医院将获得更多更客观的病例信息,为更加安全可控的使用糖宁通络胶囊提供更多的临床依据。

特此公告。

贵州百灵企业集团制药股份有限公司

董 事 会

2015年10月12日

证券代码:002574 证券简称:明牌珠宝 公告编号:2015-067

浙江明牌珠宝股份有限公司 关于筹划非公开发行股票事项并继续停牌的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

浙江明牌珠宝股份有限公司(以下简称"公司")因筹划重大事项,经公司申请,公司股票(股票简称:明牌珠宝,股票代码:002574)已于2015年6月4日开市起停牌,公司于2015年6月4日发布《重大事项停牌公告》,并于2015年6月11日至2015年7月24日期间每隔5个交易日先后发布《关于重大事项停牌进展公告》,于2015年7月31日至2015年9月29日期间每隔5个交易日先后发布《关于筹划非公开发行股票事项并继续停牌的公告》。

公司此次非公开发行股票初步投资方向为收购玉石矿业公司及投资互联网平台项目。公司与玉石矿业公司交易意向方的合作框架已经基本确定,相关协议正抓紧签订中,公司预计在10月20日完成此次非公开发行股票事项整体方案并复牌。为维护广大投资者利益,保证信息披露公平性,避免公司股价异常波动,公司股票将继续停牌,公司将在上述事项确定后及时发布公告并申请股票复牌。

停牌期间,公司将根据该事项进展情况,严格按照关法律法规的规定和要求及时履行信息披露义务,敬请广大投资者关注相关公告并注意投资风险。

特此公告。

浙江明牌珠宝股份有限公司

董事会

2015年10月12日

证券代码:002477 证券简称:雏鹰农牧 公告编号:2015-097

雏鹰农牧集团股份有限公司 关于公司职工代表监事换届选举的公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

雏鹰农牧集团股份有限公司(以下简称"公司"或"雏鹰农牧")第二届监事会任期已届满,为顺利完成监事会的换届选举工作,根据《中华人民共和国公司法》(以下简称"《公司法》")、《公司章程》等有关规定,公司于近日召开了职工代表大会。经与会职工代表审议,选举孟淑萍女士为公司第三届监事会职工代表监事(简历附后)。孟淑萍女士将与公司2015年第二次临时股东大会选举产生的两名股东代表监事共同组成第三届监事会,任期至第三届监事会届满。

上述职工代表监事符合《公司法》有关监事任职的资格和条件,最近二年内曾担任过公司董事或者高级管理人员的监事人数未超过公司监事总数的二分之一,单一股东提名的监事未超过公司监事总数的二分之一。

特此公告。

雏鹰农牧集团股份有限公司

二〇一五年十月十二日

附件:职工代表监事简历

孟淑萍女士,中国国籍,1967年出生,无永久境外居留权,中专学历,中共党员,助理会计师。2000年12月至2007年4月在新郑市天源发艺制品有限公司财务室任主管会计;2007年5月至今在雏鹰农牧工作,现任雏鹰农牧职工代表监事。孟淑萍女士未持有公司股票,与公司控股股东、实际控制人及其他董事、监事、高级管理人员不存在关联关系,未受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒,符合《公司法》等相关法律、法规和规定要求的任职条件。

股票代码:000958 股票简称:东方能源 公告编号:2015-077

石家庄东方能源股份有限公司设立灵寿东方新能源发电有限公司的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

为加快发展清洁能源产业,将清洁能源作为公司新的利润增长点,增加公司持续经营能力,公司在石家庄市灵寿县出资设立了全资子公司,进行新能源发电项目的开发、建设。目前该公司已经完成工商登记注册,现就相关情况说明如下:

一、基本情况

1、名称:灵寿东方新能源发电有限公司

2、类型:有限责任公司

3、住所:河北省石家庄市灵寿县灵寿乡雅园小区12-3-501

4、法定代表人:梁炜

5、注册资本:人民币500万元

6、成立日期:2015年10月10日

7、经营范围:光伏发电;技术咨询。

8、统一社会信用代码:91130126MA07K1C1X0

二、本次出资设立灵寿东方新能源发电有限公司的资金来源为公司自有资金,不构成关联交易及重大资产重组。

三、本次设立灵寿东方新能源发电有限公司后,拟以该公司为主体,开发、建设相关新能源项目。投资项目具备条件后,将根据相关法律法规及《公司章程》规定履行董事会或股东大会的决策程序并根据进展情况及时履行信息披露义务。

请投资者注意投资风险。

特此公告

石家庄东方能源股份有限公司董事会

2015年10月12日

证券代码:000662 证券简称:索芙特 公告编号:2015-058

索芙特股份有限公司 2015年前三季度业绩预告

一、本期业绩预计情况

1、业绩预告期间:2015年1月1日-2015年9月30日

2、预计的业绩:√ 亏损 (扭亏为盈 (同向上升 (同向下降

项 目	2015年1月1日-2015年9月30日	2014年1月1日-2014年9月30日
归属于上市公司股东的净利润	亏损:约35万元	亏损:3,637.19万元
基本每股收益	亏损:约0.0012元	亏损:0.1263元
项 目	2015年7月1日-2015年9月30日	2014年7月1日-2014年9月30日
归属于上市公司股东的净利润	亏损:约20万元	亏损:353.63万元
基本每股收益	亏损:约0.0007元	亏损:0.0123元

二、业绩预告预审计情况

业绩预告未经过注册会计师预审计。

三、业绩变动原因说明

公司前三季度归属于上市公司股东的净利润同比大幅度减少亏损,主要原因是公司调整日用化妆品销售模式为总经销商代理,市场费用同比大幅度减少。同时公司进一步强化内部控制管理,缩减了管理费用;盘活资金,融资规模同比大幅缩减,降低财务费用支出。

四、其他相关说明

上述亏损情况是公司财务部门初步测算,具体数据以公司2015年第三季度报告为准。敬请广大投资者注意投资风险。

索芙特股份有限公司

董事会

二〇一五年十月十三日

(上接B26版)

法定代表人:何如

联系人:吴群莉

联系电话:0755-82021106

传真:0755-82021165

(三)律师事务所

名称:北京市金杜律师事务所

住所:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层

办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层

负责人:王玲

联系电话:0755-22163333

传真:0755-22163390

联系人:宋萍萍

经办律师:靳庆军、宋萍萍

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:陈熹

经办注册会计师:单峰、陈熹

四、基金的名称

本基金名称:鹏华深证民营交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式,ETF联接基金

六、基金的投资目标

通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于目标ETF(投资比例不低于基金资产净值的90%)、标的指数成份股及其备选成份股,并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非标的指数成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股(首次发行或增发等)及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构允许,基金管理人可以在履行适当程序后调整上述投资范围,或将新出现的允许基金投资的其他品种纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金,以目标ETF作为主要投资标的,为使特定客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的管理。

本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、投资组合的构建

构建基金投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、制定建仓策略和逐步调整组合。

本基金通过投资于目标ETF跟踪标的指数,主要投资范围为目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股。基金管理人将对目标ETF份额流动性、目标ETF份额折溢价、以及标的指数成份股的流动性和交易成本等因素进行分析,制定合理的建仓策略,并在基金合同生效之日起3个月内达到合同约定的投资比例。此后,如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的,基金管理人将在10个工作日内进行调整。

2、目标ETF的投资方式

本基金投资目标ETF的两种方式如下:

(1)一级市场申购和赎回:目标ETF开放申购赎回后,通过其申购赎回代理券商以组合证券进行申购赎回。

(2)二级市场买入和卖出:目标ETF上市交易后,通过深圳证券交易所会员机构在二级市场进行目标ETF份额的交易。

在遵守深圳证券交易所相关规定的前提下,基金将综合考虑上述两种方式的价格因素、以及基金规模、市场交易量等其他相关因素,选择合适的方式投资目标ETF。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整后,本基金也将作相应的变更或调整。

3、目标ETF的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方式。

(1)当收到净申购时,基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建、目标ETF的申购或买入等;

(2)当收到净赎回时,基金将根据净赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出等;

4、标的指数成份股、备选成份股投资策略

本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸按照完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

5、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。基金的债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。

九、基金的业绩比较基准

深证民营价格指数收益率x95%+银行活期存款利率(税后)x5%

深证民营价格指数挑选深圳证券市场规模大、流动性好、具有代表性的100家民营上市公司股票为样本,选择时综合考虑股票的流通市值及成交金额,能够较好的反映深圳证券市场上民营企业股票价格变动的趋势,并向投资者提供投资标的。

标的指数发生变更时,业绩比较基准随之发生变更,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。同时本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告

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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,已于2015年7月15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。

本报告中所列财务数据截至2015年6月30日(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	43,248.00	0.07
	其中:股票	43,248.00	0.07
2	基金投资	55,463,775.59	92.81
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,666,732.06	6.14
8	其他资产	583,753.17	0.98
9	合计	59,757,508.82	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	43,248.00	0.07
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	-	-
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	43,248.00	0.07

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	000982	中银绒业	4,800	43,248.00	0.07

注:上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5. 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

9. 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	深证民营ETF	股票型基金	交易型开放式	鹏华基金管理有限公司	55,463,775.59	96.11

注:上述基金明细为本基金本报告期末持有的全部基金。

10. 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:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

(3)本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

12. 投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

(2)本基金投资的前十名股票没有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	8,008.34
2	应收证券清算款	210,889.24
3	应收股利	-
4	应收利息	790.45
5	应收申购款	364,065.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	583,753.17

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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	000982	中银绒业	43,248.00	0.07	重大事项

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

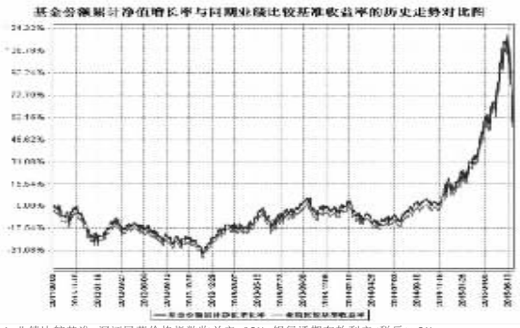
十二、基金的业绩

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财产,但不保证基金一定盈利。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、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示(本报告中所列财务数据未经审计):

	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
2011年9月2日(基金合同生效日)至2011年12月31日	-20.54%	1.45%	-23.56%	1.51%	3.02%	-0.06%
2012年1月1日至2012年12月31日	-0.96%	1.39%	-0.85%	1.42%	-0.11%	-0.03%
2013年1月1日至2013年12月31日	24.46%	1.39%	24.46%	1.40%	0.00%	-0.01%
2014年1月1日至2014年12月31日	13.79%	1.17%	14.39%	1.18%	-0.60%	-0.01%
2015年1月1日至2015年6月30日	52.39%	2.30%	53.12%	2.30%	-0.73%	0.00%
自基金合同生效日起至2015年6月30日	69.85%	1.50%	65.23%	1.51%	4.62%	-0.01%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较:



注1:业绩比较基准=深证民营价格指数收益率x95%+银行活期存款利率(税后)x5%;

注2:本基金基金合同于2011年9月2日生效。

注3:基金业绩截止日为2015年6月30日。

十三、基金的费用与税收

(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、基金财产拨划支付的银行费用;

4、基金合同生效后的基金信息披露费用;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7、基金的证券交易费用;

8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)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。

(三)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扣除所持有的目标ETF份额部分基金资产后的余额(若为负值,则取零)的0.5%年费率计提。计算方法如下:

H=Ex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扣除所持有的目标ETF份额部分基金资产后的余额,若为负值,则取零

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、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扣除所持有的目标ETF份额部分基金资产后的余额(若为负值,则取零)的0.1%年费率计提。计算方法如下:

H=Ex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扣除所持有的目标ETF份额部分基金资产后的余额,若为负值,则取零

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5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、除管理费和托管费之外的基金费用,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。

(四)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费率最高不超过申购金额的5%,投资人可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金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。

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