(上接B62版)

⑸保本周期内，担保人不符合法律法规或监管机构规定的担保人资格、或出现足以影响其担保能力情形的，基金管理人有权按照法律法规及基金合同约定的程序更换担保人，基金管理人书面通知担保人即可解除本《保证合同》，并要求担保人就其过错导致的基金财产、基金份额持有人或基金管理人的损失承担相应责任，赔偿相关损失。

（三）保证费用（即担保费）的费率和支付方式

1、保证费率

本基金的保证费用按前一日基金资产净值的2‰年费率计提。保证费用的计算方法如下：

H=E×2‰÷当年天数

H为每日应计提的保证费用

E为前一日的基金资产净值

2、支付方式

在基金保本周期内，本基金的保证费用从基金管理人的管理费收入中列支。保证费用每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于每月收到基金管理费之后的五个工作日内支付给担保人。

（四）更换担保人

1、更换担保人的情形

⑴保本周期内更换担保人应经基金份额持有人大会审议通过，但因担保人或保本义务人因歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产、丧失担保资质或其他足以影响继续履行担保责任能力的情况，以及担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人、或保本义务人的权利和义务的除外。

⑵某一保本周期结束后，基金管理人有权更换下一保本周期的担保人，更换后的担保人为本基金下一保本周期提供的担保不得影响基金份额持有人在《基金合同》项下享有的保本条款，此项变更无需召开基金份额持有人大会决议通过。

2、更换担保人的程序

⑴保本周期内更换担保人

1）提名

基金管理人、基金托管人有权提名新担保人，被提名的新任担保人必须符合如下条件：1）具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件；2）符合基金份额持有人的利益；3）同意为本基金的保本提供担保。

2）决议

基金管理人应按照《基金合同》中"基金份额持有人大会"章节中约定的程序召集基金份额持有人大会对被提名的新担保人形成决议（在基金管理人确定担保人已丧失履行担保责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人可选择更换基金担保人而不需召开持有人大会）。

3）备案：基金份额持有人大会更换担保人的决议须报中国证监会备案。

4）签订《保证合同》：基金管理人应自更换担保人的基金份额持有人大会决议生效后与新担保人签署《保证合同》。

5）公告。基金管理人应自新《保证合同》生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。

6）交接。原担保人职责终止的，原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料，及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续，基金管理人和新任担保人应及时接收。

保本周期内更换担保人的，自新《保证合同》生效之日起，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前，原担保人应继续承担保证责任。

如因担保人或保本义务人因歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产、丧失担保资质或其他足以影响继续履行担保责任能力的情况，以及担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人、或保本义务人的权利和义务的情况，使本基金需要在保本周期内更换担保人的，基金管理人有权按照法律法规及基金合同约定的条件提名并更换新担保人，不需召开持有人大会。

⑵保本周期结束后更换担保人

当期保本周期结束后，基金管理人有权更换下一保本周期的担保人，由更换后的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障机制，此项担保人更换事项无需召开基金份额持有人大会决议通过。但是基金管理人应当将涉及新担保人或保本义务人的有关资质情况、《保证合同》或《风险买断合同》等向中国证监会报备。

八、保本周期到期

（一）保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人和基金托管人认可的担保人或保本义务人同意为下一个保本周期提供保本保障，与本基金管理人签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和本《基金合同》规定的基金存续要求的情况下，本基金继续存续并进入下一保本周期，下一保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

如保本到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，于保本周期到期日次日变更为"招商灵活配置混合型证券投资基金"。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》的相关约定作相应修改。上述变更无须经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金《招募说明书》中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将根据本《基金合同》的规定终止。

（二）保本周期到期的公告

1、保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续、到期赎回或转换的到期期间以及为下一保本周期开放申购的期限等的相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时，在不符合保本基金存续条件下，本基金将变更为"招商灵活配置混合型证券投资基金"，基金管理人将在临时公告或"招商灵活配置混合型证券投资基金"的《招募说明书》中公告相关规则。

3、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

4、为了保障持有到期的基金份额持有人的利益，基金管理人可在保本周期到期前6个月内视情况暂停本基金的日常申购业务。

九、基金的投资目标

（一）保本周期内

通过保本资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，寻求组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。

（二）变更后"招商灵活配置混合型证券投资基金"（下简称"招商灵活配置混合基金"）

通过灵活动态的资产配置，在股市和债市之间选择投资机会，精选股票和债券品种，适当集中投资，致力于在多种市场环境下为投资者创造绝对收益。

十、投资方向

（一）保本周期内

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的债券、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）、权证、货币市场工具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，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于保本资产与风险资产。本基金投资的保本资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和高信用等级的企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）、货币市场工具等。本基金投资的风险资产为股票、权证等。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金保留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。

在基金实际管理过程中，基金管理人将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，在上述投资组合比例范围内，适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例。

（二）变更后"招商灵活配置混合型证券投资基金"（下简称"招商灵活配置混合基金"）

招商灵活配置混合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、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，但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。。

招商灵活配置混合基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的30%-80%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的20%-70%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

十一、基金的投资策略

（一）保本周期内

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合，利用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）技术，动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值的目的。

⑴配置策略

根据恒定比例组合保险原理，本基金将根据市场的波动、组合安全垫（即基金净资产超过基金价值底线的数额）的大小动态调整保本资产与风险资产投资的比例，通过对保本资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对风险资产的投资寻求保本期间资产的稳定增值。

⑵债券（不含可转换公司债）投资策略

本基金在债券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，采用久期匹配下的主动性投资策略，主要包括：久期匹配、期限结构配置、信用策略、相对价值判断、动态优化等管理手段，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）通过对宏观经济和市场因素的分析，确定债券组合久期

2）收益率曲线分析，确定债券组合期限结构配置

3）信用策略

4）相对价值判断

5）优化配置，动态调整

⑶可转换公司债投资策略

由于可转债兼具债性和股性，本基金采取投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下可转债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。

本基金用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。底价溢价率越高，债性特征越弱；底价溢价率越低，则债性特征越强；可转债的到期收益率越高，可转债的债性越强；可转债的到期收益率越低，可转债的股性越强。在实际投资中，可转债的底价溢价率小于10%或到期收益率大于2%的可转债可视为债性较强。

本基金用可转债的平价溢价率和可转债的Delta系数来衡量可转债的股性特征。平价溢价率越高，股性特征越弱；溢价率越低，则股性特征越强。可转债的Delta系数越接近于1，股性越强；Delta系数越远离1，股性越弱。在实际投资中，可转债的平价溢价率小于5%或Delta值大于0.6可视为股性较强。

此外，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。

⑷股票投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。

1）行业配置

在全球经济的框架下，本基金管理人通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析和预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出具有良好景气和发展潜力的行业。

2）本基金综合运用招商基金的股票研究分析方法和其它投资分析工具挑选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票构建股票投资组合。

⑸权证投资策略

本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。

1）买入权证对股票投资组合中相应的正股进行套期保值

2）根据市场隐含波动率趋势判断构建波动率差组合

3）构建套利策略获取无风险套利收益

本基金对权证的投资将严格遵守有关部门关于权证投资的相关规定。

（二）变更后"招商灵活配置混合型证券投资基金"（下简称"招商灵活配置混合基金"）

⑴资产配置方法

在资产配置方法上，投资组合管理人在借鉴国际先进投资技术的基础上，结合国内实际情况和自身的投资管理经验，建立了自己的资产配置体系。招商基金的资产配置体系分为战略资产配置和战术资产配置。

⑵股票投资策略

本基金的股票投资采取自下而上的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的且成长性良好、价值被低估的上市公司股票，构建投资组合，以寻求超越业绩基准的超额收益。

⑶货币市场工具投资

在本基金的货币市场工具投资过程中，将以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对短期金融工具的组合操作，在保持资产流动性的同时，追求稳定的投资收益。具体来说：

①在保证流动性的前提下，利用现代金融分析方法和工具，寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会；

②根据各期限各品种的流动性、收益性以及信用水平来确定货币市场工具组合资产配置；

③根据市场资金供给情况对货币市场工具组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

⑷债券投资策略

根据国内外宏观经济形势、财政、货币政策、市场资金与债券供求状况、央行公开市场操作等方面情况，采用定性与定量相结合的方式，确定债券投资的组合久期，并根据通胀预期确定浮息债与固定收益债比例；在满足组合久期设置的基础上，投资团队分析债券收益率曲线变动、各期限段品种收益率及收益率基差波动等因素，预测收益率曲线的变动趋势，并结合流动性偏好、信用分析等多种市场因素进行分析，综合评判个券的投资价值。在个券选择的基础上，投资团队构建模拟组合，并比较不同模拟组合之间的收益和风险匹配情况，确定风险、收益最佳匹配的组合。

1）债券（不含可转债）投资

在本基金的债券（不含可转债）投资过程中，本基金管理人将采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为基础，结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。

本基金所采取的主动式投资策略涉及债券组合构建的三个步骤：确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券。其中，每个步骤都采取特定的主动投资子策略，以尽可能地控制风险、提高基金投资收益。

2）可转债投资

对于本基金中可转债的投资，本基金管理人主要采用可转债相对价值分析策略。

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。

本产品用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。底价溢价率越高，债性特征越弱；底价溢价率越低，则债性特征越强；可转债的到期收益率越高，可转债的债性越强；可转债的到期收益率越低，可转债的股性越强。在实际投资中，可转债的底价溢价率小于10%或到期收益率大于2%的可转债可视为债性较强。

本产品用可转债的平价溢价率和可转债的Delta系数来衡量可转债的股性特征。平价溢价率越高，股性特征越弱；溢价率越低，则股性特征越强。可转债的Delta系数越接近于1，股性越强；Delta系数越远离1，股性越弱。在实际投资中，可转债的平价溢价率小于5%或Delta值大于0.6可视为股性较强。

其次，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。

⑸权证投资策略

本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化，灵活构建避险策略，波动率差策略以及套利策略。

1）买入权证对股票投资组合中相应的正股进行套期保值

2）根据市场隐含波动率趋势判断构建波动率差组合

3）构建套利策略获取无风险套利收益

本基金对权证的投资将严格遵守有关部门关于权证投资的相关规定。

（三）投资决策依据和投资程序

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

1、投资决策依据

⑴国家有关法律法规和本《基金合同》的有关规定；

⑵宏观经济发展态势、证券市场运行环境和走势，以及上市公司的基本面；

⑶投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系，本基金将在承担适度风险的范围内，选择收益风险配比最佳的品种进行投资。

2、投资决策流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析员、交易员在投资管理过程中责任明确、密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下：

⑴投资决策委员会审议投资策略、资产配置和其它重大事项；

⑵投资部门通过投资周会等方式讨论拟投资的个券，研究员构建模拟组合；

⑶基金经理根据所管基金的特点，确定基金投资组合；

⑷基金经理发送投资指令；

⑸交易部审核与执行投资指令；

⑹数量分析人员对投资组合的分析与评估；

⑺基金经理对组合的检讨与调整。

在投资决策过程中，风险管理部门负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

十二、业绩比较基准

（一）保本周期内

三年期银行定期存款收益率（税后）。

（二）变更后"招商灵活配置混合型证券投资基金"（下简称"招商灵活配置混合基金"）沪深300指数收益率×55%+中信全债指数收益率×45%。

十三、基金的风险收益特征

（一）保本周期内

本基金是保本混合型基金，属于证券市场中的低风险品种。

（二）变更后"招商灵活配置混合型证券投资基金"（下简称"招商灵活配置混合基金"）

招商灵活配置基金是混合型基金，属于基金中的中高风险品种。

十四、投资组合报告

招商安达保本混合型证券投资基金管理人-招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日，来源于《招商安达保本混合型证券投资基金2015年第2季度报告》。

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	1,060,202,522.55	32.99
	其中：股票	1,060,202,522.55	32.99
2	固定收益投资	2,022,911,919.22	62.95
	其中：债券	2,011,941,919.22	62.61
	资产支持证券	10,970,000.00	0.34
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	27,911,247.47	0.87
7	其他资产	102,616,531.82	3.19
8	合计	3,213,642,221.06	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	148,780,775.73	5.08
B	采矿业	–	–
C	制造业	485,997,577.24	16.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	98,249,071.58	3.36
F	批发和零售业	62,038,523.43	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	29,916,402.60	1.02
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,493,833.63	4.05
J	金融业	–	–
K	房地产业	51,868,505.60	1.77
L	租赁和商务服务业	59,928,421.06	2.05
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.03
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	4,105,800.00	0.14
S	综合	–	–
	合计	1,060,202,522.55	36.21

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	148,780,775.73	5.08
B	采矿业	–	–
C	制造业	485,997,577.24	16.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	98,249,071.58	3.36
F	批发和零售业	62,038,523.43	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	29,916,402.60	1.02
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,493,833.63	4.05
J	金融业	–	–
K	房地产业	51,868,505.60	1.77
L	租赁和商务服务业	59,928,421.06	2.05
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.03
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	4,105,800.00	0.14
S	综合	–	–
	合计	1,060,202,522.55	36.21

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	300101	振芯科技	1,571,862	87,395,527.20	2.99
2	002714	牧原股份	1,363,875	80,114,017.50	2.74
3	002477	雏鹰农牧	2,766,000	53,107,200.00	1.81
4	002285	世联行	2,419,240	51,868,505.60	1.77
5	600986	科达股份	2,012,377	48,437,914.39	1.65
6	600654	中安消	1,577,401	47,495,544.11	1.62
7	300059	东方财富	739,087	46,628,998.83	1.59
8	002405	四维图新	953,868	41,779,418.40	1.43
9	600058	五矿发展	1,234,500	40,331,115.00	1.38
10	300298	三诺生物	1,038,077	39,976,345.27	1.37

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	300101	振芯科技	1,571,862	87,395,527.20	2.99
2	002714	牧原股份	1,363,875	80,114,017.50	2.74
3	002477	雏鹰农牧	2,766,000	53,107,200.00	1.81
4	002285	世联行	2,419,240	51,868,505.60	1.77
5	600986	科达股份	2,012,377	48,437,914.39	1.65
6	600654	中安消	1,577,401	47,495,544.11	1.62
7	300059	东方财富	739,087	46,628,998.83	1.59
8	002405	四维图新	953,868	41,779,418.40	1.43
9	600058	五矿发展	1,234,500	40,331,115.00	1.38
10	300298	三诺生物	1,038,077	39,976,345.27	1.37

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	832,541,475.50	28.44
2	央行票据	–	–
3	金融债券	180,165,030.00	6.15
	其中：政策性金融债	180,165,030.00	6.15
4	企业债券	574,111,714.00	19.61
5	企业短期融资券	210,273,000.00	7.18
6	中期票据	212,887,000.00	7.27
7	可转债	1,963,699.72	0.07
8	其他	–	–
9	合计	2,011,941,919.22	68.72

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	010107	21国债(7)	2,993,910	317,204,764.50	10.83
2	010303	03国债(3)	3,132,370	314,176,711.00	10.73
3	019428	14国债28	2,000,000	201,160,000.00	6.87
4	1180038	11锡盟债	1,000,000	103,560,000.00	3.54
5	110221	11国开21	1,000,000	99,990,000.00	3.42

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1489194	14华元2A2	200,000	10,970,000.00	0.37

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。

8、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

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

10.3本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

11.1报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,122,707.75
2	应收证券清算款	67,000,000.00
3	应收股利	–
4	应收利息	34,478,947.03
5	应收申购款	14,877.04
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	102,616,531.82

11.4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。

11.5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	600654	中安消	47,495,544.11	1.62	重大事项

十五、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人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。

本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

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
2011.09.01-2011.12.31	5.10%	0.24%	1.67%	0.02%	3.43%	0.22%
2012.01.01-2012.12.31	6.47%	0.34%	4.61%	0.01%	1.86%	0.33%
2013.01.01-2013.12.31	7.24%	0.56%	4.25%	0.01%	2.99%	0.55%
2014.01.01-2014.12.31	18.98%	0.51%	4.22%	0.01%	14.76%	0.50%
2015.01.01-2015.06.30	20.18%	0.96%	1.86%	0.01%	18.32%	0.95%
基金成立起至2015.6.30	71.60%	0.55%	16.61%	0.01%	54.99%	0.54%

注：本基金合同生效日为2011年9月1日

十六、基金的费用概览

（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》生效后的信息披露费用；

4、基金份额持有人大会费用；

5、《基金合同》生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金的证券交易费用；

7、基金财产拨划支付的银行费用；

8、按照国家有关规定或《基金合同》的约定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法规规定的范围内按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的1.20%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。第一个保本周期担保人保证费用自基金管理费中列支。

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0.20%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、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的"招商灵活配置混合型证券投资基金"的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

4、上述（一）中3到8项费用由基金托管人根据其他有关法律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）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。基金募集期间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，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

（五）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。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

十七、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》、《公开募集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，对本基金管理人于2014年10月14日刊登的本基金招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在前次的招募说明书刊登后本基金的投资经营活动进行了内容补充和数据更新。

本次主要更新的内容如下：

1、在"三、基金管理人"部分，更新了"（一）基金管理人概况"、"（二）目前所管理基金的基本情况"、"（三）主要人员情况"。

2、更新了"四、基金托管人"。

3、在"五、相关服务机构"部分，更新了"（一）基金份额销售机构"。

4、在"十一、基金的投资"部分，更新了"（八）基金投资组合报告"。

5、更新了"十二、基金的业绩"。

6、更新了"二十五、其他应披露事项"。

招商基金管理有限公司
2015年10月14日

证券代码：000415　　证券简称：渤海租赁　　公告编号：2015-140

渤海租赁股份有限公司2015年度前三季度业绩预告

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、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

(1)2015年1-9月业绩预告

项 目	本报告期	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	比上年同期：增长约35.87%-45.88%	盈利：69918.30万元
	盈利：约95000万元- 102000万元	
基本每股收益	盈利：约0.2677元-0.2874元	盈利：0.4283元

(2)2015年7-9月业绩预告

项 目	本报告期	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	比上年同期：增长约34.58%-64.02%	盈利：23777.80万元
	盈利：约32000万元- 39000万元	
基本每股收益	盈利：约0.0902元-0.1099元	盈利：0.1340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

本报告期业绩较上年同期大幅提升的主要原因：

1、公司于2015年1月取得了Cronos 80%股权，合并报表范围发生变化。同时，公司租赁业务较上年同期有所增长，使得本报告期财务数据与公司2014年1-9月财务数据相比有较大幅度提升。

2、根据公司2014年度权益分配方案，2015年6月3日公积金转增股本后总股数由1,774,303,476股增至3,548,606,952股，依据调整后股数计算，年初至报告期基本每股收益约为0.2677元-0.2874元，本报告期基本每股收益约为0.0902元-0.1099元。

四、其他相关说明

本公司上述业绩是公司财务部做出的初步估算，具体数据将在公司2015年第三季度报告中披露。

公司董事会敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。公司指定的信息披露媒体为《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

特此公告。

渤海租赁股份有限公司董事会
2015年10月13日

股票代码：600682　　股票简称：南京新百　　公告编号：临 2015-066

南京新街口百货商店股份有限公司
关于重大资产重组事项进展暨继续停牌的公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

南京新街口百货商店股份有限公司（以下简称公司）因筹划重大资产重组事项，经向上海证券交易所申请，公司股票于2015年8月5日开市起停牌，并于2015年8月12日、2015年8月19日、2015年8月27日、2015年9月2日、2015年9月11日、2015年9月18日、2015年9月25日、2015年10月8日披露了该事项的进展公告。

按照相关规定，公司于2015年9月28日，召开第七届董事会第三十一次会议审议通过了《关于重大资产重组继续停牌的议案》，会议同意公司股票继续停牌，独立董事发表了表示同意的意见。经申请，公司股票自2015年10月8日开市起继续停牌，停牌时间不超过一个月。（上述信息详见上海证券交易所网站、中国证券报、上海证券报以及证券时报上刊登的公告，公告编号：临2015-047、临2015-053、临2015-054、临2015-055、临2015-056、临2015-057、临2015-061、临2015-062、临2015-063和临2015-064）。

2015年8月5日，公司获得董事会授权向China Cord Blood Corporation（中国脐带血库企业集团）（以下简称CO集团）发出收购其相关中国资产及业务权益的意向性要约函，并于8月11日收到CO集团董事会特别委员会的回函，公司已对回函中所关注的问题与事项一一回复，聘请了财务顾问，已与特别委员会就收购等相关事项进行了沟通，并经特别委员会接洽了CO集团大股东金卫医疗（0801.HK），双方就收购等相关事项进行了商谈。

停牌期间，公司积极推进重大资产重组相关工作，与相关各方对标的资产涉及相关事项及方案正在积极进行沟通与协商。上述意向性要约拟收购的标的资产行业类型为生物医药行业；本次交易的对价初步采取现金及上市公司发行股份的混合支付方式；鉴于本次收购涉及中国大陆、香港、美国三地上市公司，交易方案较为复杂，具体的标的资产范围及交易对方尚未最终确定。同时，公司并不排除将符合战略发展方向的其他境内外优质资产纳入本次重大资产重组的交易范围。

截至目前，公司已与CO集团大股东金卫医疗（0801.HK）就收购的商业条款细节进行了多轮协商，准备签署收购框架协议。公司已与财务顾问等中介机构就提供重组服务事项达成一致，中介机构正在履行内部审批手续并进行方案论证工作，同时中介机构开始对标的资产展开尽职调查。

本次收购涉及海外上市公司，收购程序复杂，相关尽职调查等方面的工作尚需较长的时间完成，且存在不确定性，经申请，公司股票于2015年10月14日开市起继续停牌。

继续停牌期间，公司将密切关注事项进展，严格按照有关规定履行信息披露义务，并按规定每五个交易日披露该事项的进展情况，敬请广大投资者关注公司公告，注意投资风险。

特此公告。

南京新街口百货商店股份有限公司董事会
2015年10月13日

股票代码：603799　　股票简称：华友钴业　　公告编号：2015-064

浙江华友钴业股份有限公司股票交易异常波动公告

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。

重要内容提示：

浙江华友钴业股份有限公司（以下简称："本公司"或"公司"）股票（股票简称：华友钴业，股票代码：603799）于2015年10月9日、10月12日、10月13日连续三个交易日内收盘价格涨幅偏离值累计超过20%，属于股票交易异常波动。经公司自查，并向公司第一大股东、第二大股东及实际控制人核实，不存在应披露而未披露的重大信息。

一、股票交易异常波动的具体情况

本公司股票于2015年10月9日、10月12日、10月13日连续三个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计超过20%，根据《上海证券交易所交易规则》的有关规定，属于股票交易异常波动。

二、公司关注并核实的相关情况

经公司自查并向公司第一大股东、第二大股东及实际控制人征询，核实情况如下：

1、经公司自查，本公司及控股子公司目前生产经营活动正常，未发现对公司股票交易价格可能产生重大影响的媒体报道或市场传闻；除公司已披露的信息外，不存在其他应披露而未披露的重大信息。

2、经公司自查及向公司第一大股东、第二大股东及实际控制人函证确认，除已按规定披露的事项外，不存在应披露而未披露的重大信息，包括但不限于重大资产重组、发行股份、上市公司收购、债务重组、业务重组、资产剥离和资产注入等重大事项。

三、是否存在应披露而未披露的重大信息的声明

本公司董事会确认，根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定，本公司目前不存在应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《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的、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。

四、上市公司认为必要的风险提示

本公司指定信息披露网站、媒体为上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）及《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》，有关公司信息以公司在上述指定网站、媒体刊登的公告为准，敬请广大投资者及时注意，充分了解投资风险，谨慎、理性投资。

特此公告。

浙江华友钴业股份有限公司董事会
2015年10月13日

证券代码：600395　　证券简称：盘江股份　　编号：临2015-064

贵州盘江精煤股份有限公司关于诉讼判决结果的公告

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。

重要内容提示：

●案件所处的诉讼阶段：一审判决。

●公司所处的当事人地位：第三被告。

贵州正业工程技术投资有限公司向贵州省六盘水市中级人民法院起诉公司参股子公司贵州首黔资源开发有限公司建设工程施工合同纠纷一案，公司已及时履行了信息披露义务，详情见公司公告（临2015-004号）。

公司于昨日收到贵州省六盘水市中级人民法院关于此案的一审《民事判决书》[(2015)黔六中民初字第00010号]，现将判决情况公告如下：

一、诉讼判决情况

贵州省六盘水市中级人民法院出具的《民事判决书》[(2015)黔六中民初字第00010号]，对此案的判决情况如下：

（一）被告贵州首黔资源开发有限公司于本判决发生法律效力之日起三个月内支付原告贵州正业工程技术投资有限公司剩余工程欠款3790.1024万元，并按中国人民银行发布的同期同类贷款利率计息（从2014年2月4日起至工程欠款付清之日止）；

（二）若被告贵州首黔资源开发有限公司的财产不足以清偿上述款项，则被告贵州首钢产业投资有限公司、贵州盘江精煤股份有限公司、首钢水城钢铁（集团）有限责任公司应在其未出资本息范围内，对贵州首黔资源开发有限公司欠款不能清偿的部分承担补充赔偿责任；

（三）驳回原告贵州正业工程技术投资有限公司的其余诉讼请求；

（四）驳回贵州首黔资源开发有限公司的反诉请求。

如果未按本判决指定的期限履行给付金钱义务，应当依照《中华人民共和国民事诉讼法》第二百五十三条规定，加倍支付迟延履行期间的债务利息。

本诉案件受理费244660元；反诉案件受理费58423元，财产保全费5000元，合计308083元，由被告贵州首黔资源开发有限公司承担。

如不服本判决，可在判决书送达之日起十五日内，向本院递交上诉状，并按对方当事人的人数提供副本，上诉于贵州省高级人民法院。

二、本次诉讼案件判决结果对公司可能产生的影响

本次诉讼案件判决结果对公司可能产生的影响存在不确定性，视本案当事人是否上诉和后续执行结果而定。

本次诉讼案件为一审判决结果，如该诉讼事项有新的进展情况，公司将持续履行信息披露义务。

三、备查文件目录

贵州省六盘水市中级人民法院《民事判决书》[(2015)黔六中民初字第00010号]。

特此公告。

贵州盘江精煤股份有限公司
董事会
2015年10月13日

股票代码：600438　　股票简称：通威股份　　公告编号：2015-081

通威股份有限公司
关于控股股东股权质押解除
并继续质押的公告

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。

通威集团有限公司持有通威股份有限公司(以下简称：本公司)57.35%的股份，为本公司控股股东。

通威集团有限公司于2015年10月12日将质押给浙商银行股份有限公司成都分行的45,000,000无限售条件流通股解除质押，同时将45,000,000无限售条件流通股继续质押给浙商银行股份有限公司成都分行，并在中国证券登记结算有限公司上海分公司办理完上述事项的相关手续；将质押给华夏银行股份有限公司成都分行的10,000,000无限售条件流通股解除质押，同时将10,000,000无限售条件流通股质押给华夏银行股份有限公司成都天府支行，并在中国证券登记结算有限公司上海分公司办理完上述事项的相关手续。两次合计质押的55,000,000无限售条件流通股占本公司总股本的6.73%。截止2015年10月12日，通威集团有限公司共质押452,240,000股份，其中无限售条件流通股327,740,000股，有限售条件流通股124,500,000股，合计占本公司总股本的55.35%。

特此公告

通威股份有限公司
董事会
二〇一五年十月十四日

股票代码：600986　　股票简称：科达股份　　公告编号：临2015-061

科达集团股份有限公司
关于出售资产评估报告的
提示性公告

本公司及全体董事保证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。

2015年10月9日，科达集团股份有限公司（以下简称"科达股份"或"公司"）董事会召开了第七届董事会临时会议，审议通过了《关于公司出售资产暨关联交易的议案》。公司拟将持有的东营黄河公路大桥有限责任公司（以下简称"大桥公司"）50%股权出售给公司控股股东山东科达集团有限公司，最终交易价格以资产评估报告为准。

银信资产评估有限公司接受公司委托，根据有关法律、法规和资产评估准则，采用收益法，按照必要的评估程序，对公司拟股权转让所涉及的大桥公司股东全部权益价值在2015年8月31日的市场价值进行了评估，最终评估的股东全部权益价值为人民币47,414万元，因此本次出售资产涉及的大桥公司50%股权的股东权益价值为人民币23,707万元。

根据第七届董事会临时会议决议，本次股权转让的最终交易价格以资产评估报告为准，为人民币23,707万元。

本次交易尚需提交公司股东大会审议。

特此公告。

科达集团股份有限公司董事会
二〇一五年十月十四日

上网公告附件

《科达集团股份有限公司拟股权转让所涉及的东营黄河公路大桥有限责任公司股东全部权益价值评估报告》

东方基金管理有限责任公司
关于调整旗下部分基金持有的
停牌股票估值方法的提示性公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证券监督管理委员会公告[2008]38 号)的规定，经与托管银行协商，东方基金管理有限责任公司(以下简称"本公司")决定自 2015 年 10月 13日起，对旗下基金所持有的下列停牌股票采用"指数收益法"进行估值，其中所用指数为中基协基金行业股票估值指数(简称"AMAC 行业指数")。

代码	名称
300070	碧水源
300168	万达信息

本公司将综合参考各项相关影响因素并与托管银行协商，待该股票交易体现了活跃市场交易特征后，将恢复采用当日收盘价格进行估值，届时不再另行公告。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资本公司旗下基金时应认真阅读各基金的基金合同、招募说明书。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

东方基金管理有限责任公司
2015年10月14日

股票简称：中远航运　　股票代码：600428　　公告编号：2015-071

中远航运股份有限公司
重大事项进展公告

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。

中远航运股份有限公司（以下简称"公司"）控股股东中国远洋运输（集团）总公司（以下简称"中远集团"）正在筹划重大事项，鉴于该等事项存在重大不确定性，经公司申请，公司股票自2015 年9月16日起继续停牌，预计继续停牌时间不超过一个月。

经向控股股东问询，目前控股股东相关事项仍在加紧筹划中，但由于所涉及事项比较复杂，可能涉及资产重组，目前相关事项仍在进 行进一步的研究和论证，包括就具体交易方案与各中介机构进行讨论、就有关事项与监管机构进行沟通等。

公司将及时与中远集团进行沟通，了解上述重大事项筹划进展情况，并将在5个交易日内公告相关事项的进展情况。

《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)为公司指定信息披露媒体，公司所有信息均以公司在上述媒体刊登的公告为准。请投资者关注公司公告，理性投资，注意风险。

特此公告。

中远航运股份有限公司董事会
二〇一五年十月十四日