证券简称:恒康医疗　　证券代码:002219　　公告编号:2016-26

恒康医疗集团股份有限公司关于对深圳证券交易所重组问询函延期回复并继续停牌的公告

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。

恒康医疗集团股份有限公司(以下简称"公司")因筹划重大对外投资事项,经申请,公司股票(证券简称:恒康医疗;证券代码:002219)自2015年7月8 日开市起停牌。 经确认,该重大对外投资事项构成重大资产重组,公司于 2015 年7月22日发布了《关于筹划重大资产重组的停牌公告》。2015年7月27日,公司召开第三届董事会第四十三次会议,审议通过了《关于筹划重大资产重组的议案》,同意公司筹划重大资产重组事项,2015 年 8 月 21 日披露了《关于重大资产重组进展暨延期复牌的公告》;2015 年 10 月 19 日,公司第三届董事会第四十八次会议审议通过了《公司重大资产重组股票继续停牌的议案》; 2015 年 10 月 22日,披露了《重大资产重组进展暨股票继续停牌的公告》;2015 年 11 月 5 日,公司 2015 年第五次临时股东大会审议批准了《公司重大资产重组股票继续停牌的议案》;2016 年 1 月 20 日,公司第四届董事会第四次会议审议通过了公司重大资产重组相关议案,并于 2016 年 1 月 22 日披露了《重大资产购买报告书(草案)》等相关公告。上述公告内容详见公司在《证券时报》、《证券日报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(www.cninofo.com.cn)披露的相关公告。

根据中国证券监督管理委员会《关于〈上市公司重大资产重组管理办法〉实施后有关监管事项的通知》的要求,深圳证券交易所需对公司本次重组相关文件进行事后审核,公司股票自2016年1月22日起继续停牌。

2016年2月1日,公司收到深圳证券交易所《关于对恒康医疗集团股份有限公司的重组问询函》(中小板重组问询函(不需行政许可)【2016】第1号,以下简称"问询函")。根据该函,深圳证券交易所对公司提交的《重大资产购买报告书(草案)》进行了审阅,提出了若干反馈意见,并要求公司做出书面说明。公司在收到问询函后,积极组织相关中介机构及交易对方共同对反馈意见逐项落实及回复,鉴于问询函涉及的相关数据及情况需进一步核实、查证,并需要独立财务顾问广发证券股份有限公司出具相关核查意见,及修订《重大资产购买报告书(草案)》等本次重大资产重组系列文件。

经公司向深圳证券交易所申请并经交易所同意,公司将延期回复问询函,回复期间,公司股票将继续停牌,待回复经深圳证券交易所核准并披露后公司股票将申请复牌。公司股票继续停牌期间,公司将根据相关事项情况,至少每五个交易日披露一次进展公告。以此给投资者带来的不便,公司董事会深表歉意。

公司公开披露的信息均以指定媒体《证券时报》、《证券日报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(www.cninofo.com.cn)刊登的公告为准。敬请广大投资者注意风险。

特此公告。

恒康医疗集团股份有限公司董事会
二〇一六年二月四日

证券简称:恒康医疗　　证券代码:002219　　公告编号:2016-27

恒康医疗集团股份有限公司关于取消召开2016年第一次临时股东大会的公告

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

恒康医疗集团股份有限公司(以下简称"公司")于 2015年1月22日在《证券时报》、《证券日报》《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(www.cninofo.com.cn)上刊登了《关于召开 2016年第一次临时股东大会的通知》,定于2016年2月16 日召开 2016年第一次临时股东大会,审议《关于<恒康医疗集团股份有限公司重大资产购买报告书(草案)>及其摘要的议案》等议案。

公司于2016年1月20日召开第四届董事会第四次会议,审议通过了《关于<恒康医疗集团股份有限公司重大资产购买报告书(草案)>及其摘要的议案》、《关于召开 2016年第一次临时股东大会的通知》等相关议案,并于2016年1月22日进行了披露。根据中国证券监督管理委员会《关于〈上市公司重大资产重组管理办法〉实施后有关监管事项的通知》的要求,深圳证券交易所需对公司本次重组相关文件进行事后审核,公司股票自2016年1月22日起继续停牌。

2016年2月1日,公司收到深圳证券交易所《关于对恒康医疗集团股份有限公司的重组问询函》(中小板重组问询函(不需行政许可)【2016】第1号,以下简称"问询函")。根据该函,深圳证券交易所对公司提交的《重大资产购买报告书(草案)》进行了审阅,提出了若干反馈意见,要求公司做出书面说明。公司在收到问询函后,积极组织相关中介机构及交易对方共同对反馈意见逐项落实,鉴于问询函涉及的相关数据及情况需进一步核实、查证,并需要独立财务顾问广发证券股份有限公司出具相关核查意见,及修订《重大资产购买报告书(草案)》等本次重大资产重组系列文件。

经公司向深圳证券交易所申请并经交易所同意,公司将延期回复问询函,鉴于公司2016年第一次临时股东大会主要审议《关于<恒康医疗集团股份有限公司重大资产购买报告书(草案)>及其摘要的议案》等系列议案,因相关数据及情况需进一步核实、查证,《关于<恒康医疗集团股份有限公司重大资产购买报告书(草案)>及其摘要的议案》等系列议案将根据交易所同意后的回复进行修订,根据目前相关情况,公司预计不能在2016年第一次临时股东大会召开前完成相关回复工作。

因此,本次股东大会召集人公司董事会决定取消本次股东大会,待公司完成问询函回复之后,公司董事会将另行发出召开股东大会通知,审议《关于<恒康医疗集团股份有限公司重大资产购买报告书(草案)>及其摘要的议案》等本次重大资产重组系列议案。

因公司董事会取消本次股东大会召开,给投资者及股东带来的不便深表歉意!公司及相关中介机构将全力加快问询函回复相关工作,争取早日召开股东大会审议上述议案。

特此公告。

恒康医疗集团股份有限公司董事会
二〇一六年二月四日

兴业基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告

兴业基金管理有限公司(以下简称"本公司")的董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在本公司全资设立的子公司兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")兼职及领薪情况如下:

1、董事长卓新章先生兼任兴业财富执行董事;
2、总经理助理庄孝强先生兼任兴业财富总经理;
3、总经理助理张顺国先生兼任兴业财富投资总监;
4、监察稽核部负责人赵正义女士兼任兴业财富监事。

兴业财富委托本公司为其业务提供研究、销售和客户服务、监察稽核、人力资源管理、交易、财务管理及后台和信息技术等服务,兴业财富承担一定比例的人工成本。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2016年2月4日

兴业保本混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2016年 2月 4 日

1. 公告基本信息

基金名称	兴业保本混合型证券投资基金
基金简称	兴业保本混合
基金主代码	002338
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
公告依据	《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》以及《兴业保本混合型证券投资基金基金合同》、《兴业保本混合型证券投资基金招募说明书》

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		证监许可【2015】2981号
基金募集期间		自 2016年1月18日 至 2016年1月29日止
验资机构名称		德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
募集资金划入基金托管专户的日期		2016年2 月2 日
募集有效认购总户数(单位:户)		9596
募集期间净认购金额(单位:人民币元)		1,445,940,903.47
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)		506,525.41
募集份额(单位:份)	有效认购份额	1,445,940,903.47
	利息结转的份额	506,525.41
	合计	1,446,447,428.88
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	0.00
	占基金总份额比例	0.00%
	其他需要说明的事项	无
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	115,347.36
	占基金总份额比例	0.0080%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2016年2月3日

注:(1)按照有关法律规定,本基金基金合同生效前所发生的律师费、会计师费、信息披露费等费用由基金管理人承担,不从基金财产中列支。

(2)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总额的数量区间为0。

(3)本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

3. 其他需要提示的事项

1、自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

2、本基金的申购、赎回将于基金合同生效之日起3个月内开始办理,在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2016年2月4日

兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2016年2月4日

1. 公告基本信息

基金名称	兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴业聚盛灵活配置混合
基金主代码	002301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	中国民生银行股份有限公司
公告依据	《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》以及《兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		证监许可【2015】1490号
基金募集期间		自 2015年12月31日 至 2016年1月29日止
验资机构名称		德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
募集资金划入基金托管专户的日期		2016年2月1日
募集有效认购总户数(单位:户)		242
募集期间净认购金额(单位:人民币元)		200,090,543.36
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)		34.14
募集份额(单位:份)	有效认购份额	200,090,543.36
	利息结转的份额	34.14
	合计	200,090,577.50
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	0.00
	占基金总份额比例	0.00
	其他需要说明的事项	无
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	18,802.40
	占基金总份额比例	0.0094%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2016年2 月 3 日

注:(1)按照有关法律规定,本基金基金合同生效前所发生的律师费、会计师费、信息披露费等费用由基金管理人承担,不从基金财产中列支。

(2)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总额的数量区间为0。

(3)本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

3. 其他需要提示的事项

1、自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

2、本基金的申购、赎回将于基金合同生效之日起3个月内开始办理,在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2016年2月4日

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2016年2月4日

1. 公告基本信息

基金名称	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴业聚宝灵活配置混合
基金主代码	002330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
公告依据	《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》以及《兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

2. 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		证监许可【2015】1686号
基金募集期间		自 2016年1月11日 至 2016年1月29日止
验资机构名称		德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
募集资金划入基金托管专户的日期		2016年2月2日
募集有效认购总户数(单位:户)		291
募集期间净认购金额(单位:人民币元)		201,699,997.88
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)		9,829.73
募集份额(单位:份)	有效认购份额	201,699,997.88
	利息结转的份额	9,829.73
	合计	201,709,827.61
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	0.00
	占基金总份额比例	0.00%
	其他需要说明的事项	无
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	111,070.22
	占基金总份额比例	0.0550%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2016年2月3日

注:(1)按照有关法律规定,本基金基金合同生效前所发生的律师费、会计师费、信息披露费等费用由基金管理人承担,不从基金财产中列支。

(2)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总额的数量区间为0。

(3)本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

3. 其他需要提示的事项

1、自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

2、本基金的申购、赎回将于基金合同生效之日起3个月内开始办理,在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2016年2月4日

(上接B77版)

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:鹏华消费优选混合型证券投资基金

五、基金的运作方式和类型

(一)本基金运作方式
契约型开放式
(二)本基金类型
混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,精选大消费类的优质上市公司,力求超额收益及长期资本增值。

七、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、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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%,其中投资于大消费类的股票占股票资产的比例不低于80%;债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的40%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可调整上述投资比例,或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

1.资产配置策略

本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势,政策环境,利率走势,证券市场走势等及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,运用定量及定性相结合的手段,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2.股票投资策略

本基金致力于挖掘大消费类行业中的优质上市公司。通过对宏观经济、行业竞争格局、企业竞争优势等进行综合分析、评估,精选具有良好基本面及估值优势的大消费类上市公司构建股票投资组合。

(1)大消费类行业的范畴

本基金所指的大消费类是指为了满足个人日常生活所需,所购买、使用商品或接受服务的直接或间接的行为。大消费类行业包括消费行业以及与消费行业密切相关的行业。消费行业指居民通过货币购买有形或无形的消费品所形成的行业。如果按照消费对象划分,消费行业可分为两大类:一是实物消费,即以商品形式存在的消费品的消费,比如食品、饮料、日用品等;二是劳务消费,即以劳务形式存在的消费品的消费,比如旅游、教育、娱乐等。消费行业密切相关的行业指为生产消费品的行业提供服务或产品的行业,比如银行为企业运作提供融资或贷款,航空货运物流为实物商品运输提供航空货运、快递及物流服务,包装印刷为食品、日化产品、医药等提供外包装等。

以申银万国的行业分类为例,申银万国23个一级行业分类标准中属于大消费类行业的包括餐饮旅游、电子元器件、房地产、纺织服装、公用事业、交通运输、交运设备、家用电器、建筑建材、金融服务、农林牧渔、轻工制造、商业贸易、食品饮料、信息服务、信息设备、医药生物等。

(2)个股选择

本基金根据消费及消费相关行业的定义筛选出备选股票池,并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的大消费类上市公司,构建股票投资组合。

1)自上而下

本基金根据经济发展的不同阶段,居民不同收入水平和财富水平下,大消费类各个子行业不同发展周期,寻找消费领域带来的投资机会,发掘在消费增长的某个阶段体现出增长较快特征的行业。根据发达国家经验,随着收入和财富水平的不断提高,有些行业在消费支出中占有的比重将越来越大,比如医疗、娱乐、交通等行业,增速会快于整个消费行业,长期来看,更容易孕育有竞争优势的公司。

2)自下而上

① 公司基本面

通过对公司所处行业的竞争格局、市场地位、财务状况、盈利能力、发展潜力、经营能力、核心产品竞争力、公司治理结构、管理层经营能力、人才资源等各方面的分析研究,选择基本面优异的上市公司。

② 公司估值水平

公司的估值决定于公司的资产负债及其获利能力,通过相对估值法及绝对估值法选取价值被低估的上市公司,主要采用的估值指标包括PE、PEG、PB、EV/EBITDA等。

3.债券投资策略

本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等,采取积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。

4.权证产品投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。

(二)投资决策依据及程序

1.投资决策依据
(1)有关法律、法规、基金合同等的相关规定;
(2)经济运行态势和证券市场走势;
(3)经济结构转型及消费行业状况。

2.投资决策程序

(1)本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划、投资原则及其它重大事项;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作;

(2)基金经理构建、调整投资组合,并在此过程中充分考虑以下因素:每日基金申购和赎回净现金流量;基金合同的投资限制和比例限制;研究团队的投资建议;绩效与风险评估小组的建议等;

(3)交易执行相关部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(4)风险绩效相关部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,
并提供相关绩效评估报告;

(5)监察稽核相关部门对投资合规性进行监控;

(6)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%　　沪深300指数选样科学客观,行业代表性好,流动性高,抗操纵性强,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面,期限构成宽泛,适于做基金债券资产的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2015年10月22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9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	195,345,158.92	74.24
	其中:股票	195,345,158.92	74.24
2	基金投资	-	-
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	66,637,059.44	25.32
8	其他资产	1,159,340.57	0.44
9	合计	263,141,558.93	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	7,218,901.38	2.78
B	采矿业	-	-
C	制造业	77,382,244.06	29.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	588.20	0.00
E	建筑业	6,849,100.05	2.64
F	批发和零售业	7,614,546.00	2.93
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	49,824,562.85	19.19
J	金融业	862,661.66	0.33
K	房地产业	15.50	0.00
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	12,540,572.04	4.83
R	文化、体育和娱乐业	33,051,967.18	12.73
S	综合	-	-
	合计	195,345,158.92	75.23

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	300017	网宿科技	253,912	13,383,701.52	5.15
2	300363	博腾股份	555,777	12,577,233.51	4.84
3	300015	爱尔眼科	453,711	12,540,572.04	4.83
4	002292	奥飞动漫	414,057	12,115,307.82	4.67
5	300133	华策影视	417,686	10,191,538.40	3.92
6	002664	信质电机	376,414	9,109,218.80	3.51
7	300063	天龙集团	242,221	8,598,845.50	3.31
8	300027	华谊兄弟	265,700	8,404,091.00	3.24
9	600804	鹏博士	380,861	8,199,937.33	3.16
10	300251	光线传媒	297,489	8,177,972.61	3.15

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名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名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名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名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
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
10、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
注: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
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券之一的鹏博士之发行人鹏博士电信传媒集团股份有限公司(简称鹏博士)于2014年10月24日收到中国证券监督管理委员会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(行政监管措施决定书[2014]15号),称鹏博士公司披露的2011、2012、2013年年度财务报告中现金流量表及补充资料的数据存在错误,要求提交书面整改报告。鹏博士公司于2014年11月01日公告了相应的整改报告。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为鹏博士公司作为国内最大的民营宽带运营商,将长期受益于互联网行业的发展,2011年-2013年公司披露的现金流量表的部分错误并不产生实质性影响。本次行政警示函对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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)报告期内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	1,060,288.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,748.76
5	应收申购款	87,303.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,159,340.57

(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	300027	华谊兄弟	8,404,091.00	3.24	重大事项

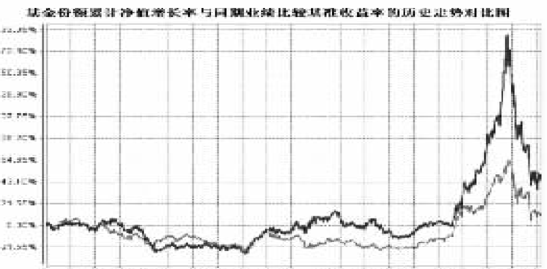
(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

1、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(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
2010年12月28日(基金合同生效日)至2010年12月31日	0.80%	0.48%	0.77%	1.29%	0.03%	-0.81%
2011年1月1日至2011年12月31日	-17.86%	1.09%	-19.44%	1.04%	1.58%	0.05%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.19%	1.21%	7.09%	1.02%	-1.90%	0.19%
2013年1月1日至2013年12月31日	15.38%	1.39%	-5.90%	1.12%	21.28%	0.27%
2014年1月1日至2014年12月31日	36.12%	1.36%	42.57%	0.97%	-6.45%	0.39%
2015年1月1日至2015年9月30日	8.77%	2.71%	-5.55%	2.16%	14.32%	0.55%
自基金合同生效日起至2015年9月30日	48.80%	1.58%	10.17%	1.28%	38.63%	0.30%

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:



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。

注1:鹏华消费优选混合型基金的业绩比较基准=沪深300指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%;
注2:基金业绩截止日为2015年9月30日;
注3:本基金基金合同的生效日为2010年12月28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、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
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0.25%的年费率计提。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3-7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
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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
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)与基金销售有关的费用

1、申购费率

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其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

申购金额M(元)	特定申购费率
M<100万	0.6%
100万≤ M <500万	0.6%
M≥ 500万	每笔1000元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率费率如下表:

申购金额M(元)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤ M <500万	1.0%
M≥ 500万	每笔1000元

本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费率

持有年限(Y)	赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

本基金的赎回费用由赎回申请人承担,并在投资者赎回本基金份额时收取。

赎回费总额的25%归基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费等。

3、基金管理人和基金托管人协商后,可以根据《基金合同》的相关约定调整申购费率、降低赎回费率或调整收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(五)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、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等,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,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日前2日在至少一种指定媒体上公告。

(六)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《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规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、因基金名称变更、基金类型由股票型基金变更为混合型基金,对招募书相应部分进行了更新。
2、在"重要提示"部分明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
3、对"三、基金管理人"中的相关内容做了更新。
4、对"四、基金托管人" 中的相关内容做了更新。
5、对"五、相关服务机构"一章的相关内容进行了更新。
6、对"八、基金的投资" 中的相关内容做了更新。
7、对"九、基金的业绩" 中的相关内容做了更新。
8、对"二十一、其他应披露事项" 中的相关内容做了更新。

鹏华基金管理有限公司
2016年2月

(上接B78版)

2、资产配置策略

本基金采用"自上而下"的投资方法,定性分析与定量分析并用,综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素,研判市场时机,结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况,进行资产配置及组合的构建,合理确定基金在股票、债券、现金等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

3、股票投资策略

本基金遵循行业间优势配置、各行业内个股优势配置相结合的股票投资策略,其中行业间优势配置是以若干财务指标、行业生命周期、政策支持力度、国际国内政治经济环境、估值与成长性等定性与定量指标为基础,以"金鹰行业优势评估模型"作为评价工具,筛选出经济周期不同阶段的优势行业,这些优势行业具有综合性的比较优势、较高的投资价值、能够取得超越各行业平均收益率的投资收益;行业内个股优势配置是以若干财务指标、估值、成长性、在所属行业当中的竞争地位、国际国内政治经济环境对企业的差异化影响、政府财政与货币政策以及其他特定政策目标对企业的差异化影响、企业的盈利前景及成长空间、重组与资产注入以及整体上市对企业的影响等定性与定量指标为基础,以"金鹰企业优势评估模型"作为评价工具,筛选出经济周期与行业发展的不同阶段下,具有综合性的比较优势、较高的投资价值、能够取得超越行业指数收益率的优势个股。

在筛选出优势行业与各行业内优势个股的基础上,根据行业优势指数的大小,筛选各行业内企业优势指数排名居前的品种构建本基金的初级股票库,行业优势指数越大,则该行业内进入初级股票库的品种越多;根据实地调研所获取的、关于企业与行业的相关信息,对财务指标、估值指标、行业优势指数与企业优势指数进行再审视,遴选企业优势指数优异者进入二级重点库与一级重点库,构建本基金的投资组合。

本基金将对行业和个股的综合性比较优势进行持续评估,以准确把握优势行业及优势个股的变化趋势,根据国内外政治经济环境与行业景气状况的最新变化,重新评估行业优势指数与企业优势指数,并据此对投资组合当中的行业和个股进行及时调整。

(1)行业配置策略

本基金的行业配置采用定性分析与定量分析相结合的方法,以行业内各企业的财务指标、行业生命周期与景气度的变化、政策支持力度、国际国内政治经济环境、估值与成长性等定性与定量指标为基础,以实地调研所获知的关于各行业的发展态势与景气变化为参考依据,以"金鹰行业优势评估模型"作为评价工具,根据"金鹰行业优势指数"预判与寻找那些具有相对比较优势的行业,力图使得这些优势行业的投资收益超越市场当中各行业收益率的平均值。对优势行业进行重点配置,可以有效地提升投资组合的收益率。优势行业的评估因素有:

1)行业内各企业的若干财务指标与估值指标;
2)国际经济环境、全球产业周期对行业的影响;
3)政府财政政策对行业的影响;
4)央行货币政策对于行业的影响;
5)政府特定政策目标对行业的影响;
6)国内经济环境的变动状况对行业的影响;
7)行业随着科技进步的变动趋势;
8)国内外政治环境的变动对行业的影响;
9)行业的盈利前景及成长空间分析;
10)国内外突发事件、重大事件对于行业的影响;

如前所述,本基金对优势行业进行重点配置,故而,为提高本基金行业配置的有效性,必须根据行业内各企业的财务指标、行业生命周期与景气度的变化、政策支持力度、国际国内政治经济环境、估值与成长性的最新变化,结合实地调研所获知的关于各行业的发展态势与景气变化的最新信息,审慎评估并重新计算行业优势指数,并据此对初级股票库、二级重点库、一级重点库、投资组合当中的行业构成进行及时调整。

在基金投资过程中,行业配置方案建立在整个投研团队的研究支持基础之上,投资决策委员会负责制定行业配置方案,基金经理负责执行行业配置方案,并进行相应的反馈。

(2)个股精选策略

根据行业配置方案,本基金审慎遴选各行业内部具有综合性比较优势的个股以构建股票投资组合。

本基金主要通过定量分析和定性分析相结合的方式构建"金鹰企业优势评估模型",根据该模型计算"金鹰企业优势指数"来考察和筛选具有综合性比较优势的股票。定量方面,主要依据盈利能力、成长性、现金流状况、偿债能力、营运能力、估值等等;定性方面主要考虑:国际经济环境以及全球产业周期对企业的差异化影响、政府财政政策对企业的差异化影响、央行货币政策对于企业的差异化影响、政府特定政策目标对企业的差异化影响、国内经济环境的变动状况对企业的差异化影响、企业随着科技进步的变动趋势、国内外政治环境的变动对企业的差异化影响、企业的盈利前景及成长空间分析、国内外突发事件与重大事件对于企业的差异化影响、重组与资产注入以及整体上市对企业的影响等等。

在实地调研的基础上,对企业优势指数进行再审视,以遴选具体投资品种。主要内容包括:

1)财务指标的进一步细化分析

在一个较长的时间维度内(3年或者3年以上),仔细考察企业的盈利能力、成长性、现金流状况、偿债能力、营运能力的变动状况及其变动趋势的稳定性;是否具有良好的治理结构,财务健康度等。

2)核心竞争力与可持续成长能力的再考察

主要考察企业是否具有与行业竞争结构相适应的、清晰的竞争战略,是否拥有成本优势、规模优势、品牌优势与美誉度、渠道优势或其它特定优势;在特定领域是否拥有原材料、专有技术或其它专有资源;是否具有较强技术创新能力;所处的行业(或者细分行业)未来的成长空间;产品的市场占有率。

3)对管理层与财务指标真实性的考察

通过实地调研可深入了解企业的基本面,实地调查企业生产任务的饱满程度,亲身感受公司管理层的企业家精神,采用实地调研所获知的第一手信息对企业优势指数进行修正。此外,对公司的上下游客户、竞争对手进行调查研究,有助于深入了解公司的经营状况,必要时还可以从行业主管机关、税务部门、海关等获取第三方数据,以核实企业基本面与财务指标的真实性。

4)估值指标的再审视

具备长期优势的品种亦可能存在阶段性的估值偏高。在实地调研的基础上,研究员客观、公正、审慎地预测公司未来每股盈利,并根据不同行业的属性,选取恰当的估值方法对公司进行估值,将公司的估值水平与国内外同行业的公司作比较,可以提供公司估值的新视角。

最后根据行业配置方案,结合定量和定性研究以及实地调研,筛选出相关行业中基本面健康、最具投资价值的优势个股作为本基金的核心投资标的,进行重点投资。

4、债券投资策略

在资本市场国际化的背景下,通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势,采取自上而下的策略构造组合。

债券类品种的投资,追求在严格控制风险基础上获取稳健回报的原则。

(1)本基金采用目标久期管理方法作为本基金债券类证券投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势,作为组合久期选择的主要依据。

(2)结合收益率曲线变化的预测,采取期限结构配置策略,通过分析和情景测试,确定长、中、短期三种债券的投资比例。

(3)收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上,进行类属的配置,优化组合收益。

(4)在运用上述策略方法基础上,通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素,选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象,并形成组合。本基金还将采取积极主动的策略,针对市场定价错误和回购套利机会等,在确定存在超额收益的情况下,积极把握市场机会。

(5)根据基金申购、赎回等情况,对投资组合进行流动性管理,确保基金资产的变现能力。

5、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证,或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。

本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合以及在合同许可投资比例范围内的投资于价值出现较为显著的低估的权证品种。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

本基金采用沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准,主要理由是:(1) 沪深300指数是上海和深圳证券交易所第一次联合发布的、反映A股市场整体走势的指数,指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有较强的独立性、代表性和良好的流动性;(2)沪深300指数是一只符合国际标准的优良指数,该指数体现出与市场整体表现较高的相关度,且指数历史表现强于市场平均收益水平,风险调整后收益也较好,具有良好的投资价值;(3)沪深300指数编制方法的透明度较高;且具有较高的市场认同度和未来广泛使用的前景,使基金之间更易于比较。

本基金采用中证全债指数作为债券投资部分的业绩比较基准,主要理由是:(1)中证全债指数是一个综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。具有较广的覆盖面,成分债券的流动性较高;(2)中证全债指数是由中证指数有限公司编制和维护,中证指数有限公司提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力;(3)中证全债指数编制方法的透明度较高;且具有较高的市场认同度和未来广泛使用的前景,使基金之间更易于比较。

如果今后法律法规发生变化,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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,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。

十、风险收益特征

本基金为主动管理的混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的风险和预期收益较高品种。一般情形下,其预期风险和收益均高于货币型基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

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。

本基金的托管人根据相关法律法规及本基金合同的规定,已复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为2015年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	240,504,016.06	90.75
	其中:股票	240,504,016.06	90.75
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	20,485,890.67	7.73
7	其他各项资产	4,020,360.17	1.52
8	合计	265,010,266.90	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	177,894,179.67	69.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,241,370.13	11.81
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	20,069,009.66	7.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,485,505.60	2.53
N	水利、环境和公共设施管理业	5,813,951.00	2.27
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	240,504,016.06	93.95

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	600079	人福医药	1,050,483	23,383,751.58	9.13
2	600969	郴电国际	1,213,341	22,968,545.13	8.97
3	002594	比亚迪	345,823	22,271,001.20	8.70
4	002614	蒙发利	1,061,799	20,588,282.61	8.04
5	001979	招商蛇口	962,081	20,069,009.66	7.84
6	002249	大洋电机	1,383,206	18,341,311.56	7.16
7	002096	南岭民爆	582,400	15,148,224.00	5.92
8	600699	均胜电子	404,264	14,517,120.24	5.67
9	002236	大华股份	342,526	12,639,209.40	4.94
10	002011	盾安环境	575,354	9,619,918.88	3.76

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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
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
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。
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。
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
本基金本报告期末无股指期货持仓。
(2)本基金投资股指期货的投资政策
无。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。
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本期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没有超出基金合同规定的备选股票库。
(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	154,680.41
2	应收证券清算款	2,442,109.96
3	应收股利	-
4	应收利息	5,194.27
5	应收申购款	1,418,375.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,020,360.17

(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	600699	均胜电子	14,517,120.24	5.67	因重大事项停牌
2	002011	盾安环境	9,619,918.88	3.76	因重大事项停牌

(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,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。

(一)基金业绩与同期基准的比较

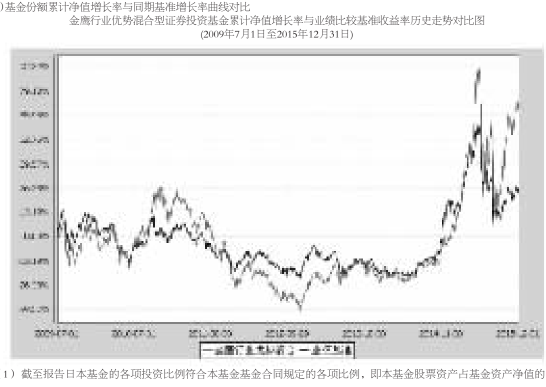
本基金合同生效日为2009年7月1日,基金合同生效以来(截至2015年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

金鹰行业优势混合型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2009.7.1-2009.12.31	3.02%	1.89%	10.39%	1.60%	-7.37%	0.29%
2010.1.1-2010.12.31	17.96%	1.60%	-8.38%	1.18%	26.34%	0.42%
2011.1.1-2011.12.31	-37.49%	1.37%	-18.23%	0.97%	-19.26%	0.40%
2012.1.1-2012.12.31	-6.98%	1.43%	6.86%	0.96%	-13.84%	0.47%
2013.1.1-2013.12.31	14.13%	1.28%	-5.15%	1.05%	19.28%	0.23%
2014.1.1-2014.12.31	19.62%	1.10%	39.13%	0.91%	-19.51%	0.19%
2015.1.1-2015.12.31	74.62%	2.92%	6.77%	1.86%	67.85%	1.06%
2009.7.1-2015.12.31	68.45%	1.74%	24.52%	1.24%	43.93%	0.50%

(二)基金份额累计净值增长率与同期基准增长率曲线对比

金鹰行业优势混合型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
(2009年7月1日至2015年12月31日)



注:(1) 截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,即本基金股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%;债券、货币市场工具、现金、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证券品种占基金资产净值的比例为5%-40%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0-3%;(2)本基金的业绩比较基准为:原为沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%,2015年9月28日起变更为沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

十三、基金的费用和税收

(一)与基金运作有关的费用
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)在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
(9)依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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。

3、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
基金管理人的基金管理费按基金财产净值的1.5%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金财产净值的1.5%年费率计提。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 为前一日基金财产净值
基金管理费每日计提,按月支付。基金管理人应于次月首日起5个工作日内做出划付指令;基金托管人应在次月首日起10个工作日内完成复核,并从该基金财产中一次性支付基金管理费给该基金管理人。

(2)基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.25%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金财产净值的0.25%年费率计提。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 为前一日的基金财产净值
基金托管费每日计提,按月支付。基金管理人应于次月首日起5个工作日内做出划付指令;基金托管人应在次月首日起10个工作日内完成复核,并从该基金财产中一次性支付托管费给该基金托管人。

(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。

4、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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

5、基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,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日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

6、其他费用
按照国家有关规定和基金合同约定,基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用,并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费
投资人申购本基金需缴纳申购费,投资人在同一天多次申购的,根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。
申购费率如下:

申购金额(万元)	申购费率
A <50	1.5%
50 ≤ A <100	1.2%
100 ≤A <500	0.8%
A ≥500	每笔1000元

注:上表中,A为投资者申购金额。

2、赎回费
本基金的赎回费率为0.5%。
本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,赎回费总额25%的部分归基金财产所有,其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、转换费
基金管理人在适当时候将为投资人办理基金间的转换业务并收取转换费,具体转换费率以及收取方式在基金转换公告中列明。

4、基金管理人可以从本基金财产中计提销售服务费,用于基金的持续销售和服务基金份额持有人,具体办法按中国证监会有关规定执行。

5、投资者通过本公司网上交易系统(www.gefund.com.cn)进行申购、赎回的交易费率,请具体参照公司网站上的相关说明。

6、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定的范围内调整上述费率,上述费率如发生变更,基金管理人应最迟于新的费率实施前2 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定交易方式(如网上交易、电话交易等)或特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回费率和其他相关费率。

(三)基金的税收
1、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。
2、根据财政部规定,从2008年9月19日起单向征收证券交易印花税,即取消买入股票的证券交易印花税,卖出股票的税率维持在1‰。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券基金运作管理办法》、《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2015年8月13日披露的《金鹰行业优势混合型证券投资基金更新的招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

(1)在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人的情况;
(2)在"四、基金托管人"部分,更新了有关基金托管人的资料信息;
(3) 在"五、相关服务机构"部分,对机构与人员的信息按照最新变动情况进行了更新:
(4)在"八、(五)申购和赎回的数额和价格"部分,修改了本基金的申购与赎回下限内容;
(5)在"十三、(五)业绩比较基准"部分,更新了本基金的业绩比较基准
(6)在"十三、(十)基金投资组合报告"部分,更新了本基金最近一期投资组合报告的内容;
(7)在"十四、基金的业绩",更新了自本基金的基金合同生效以来的投资业绩;
(8)在"二十六、其他应披露事项"部分,更新了本基金在本报告期内公开披露的信息内容。

金鹰基金管理有限公司
2016年2月4日