（上接B73版）

（1）报告期末指数投资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	–	–
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	1,162,954,957.43	94.89
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	1,162,954,957.43	94.89

（2）报告期末积极投资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	采掘业	114,020.85	0.01
C	制造业	473,042.18	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	36,234.48	0.00
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	623,297.51	0.05

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（1）报告期末指数投资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	600030	中信证券	10,186,543	181,320,465.40	14.80
2	600837	海通证券	10,473,445	149,665,529.05	12.21
3	601688	华泰证券	4,227,164	72,326,776.04	5.90
4	600999	招商证券	3,758,538	67,240,244.82	5.49
5	000776	广发证券	3,830,407	64,044,405.04	5.23
6	601377	兴业证券	6,999,810	61,528,329.90	5.02
7	000166	申万宏源	5,768,508	51,282,036.12	4.18
8	000783	长江证券	4,296,365	44,166,632.20	3.60
9	601901	方正证券	5,327,608	42,194,655.36	3.44
10	601099	太平洋	5,940,052	40,986,358.80	3.34

（2）报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002791	坚朗五金	3,973	149,345.07	0.01
2	002792	通宇通讯	3,081	135,440.76	0.01
3	601020	华钰矿业	4,377	114,020.85	0.01
4	603861	白云电器	4,056	96,735.60	0.01
5	300474	景嘉微	2,467	48,451.88	0.00

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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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）

1、广发证券

本组合投资的前十名证券之一广发证券股份有限公司（以下简称"广发证券"）于2015年9月10日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71号）。根据《告知书》，广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为。中国证监会对广发证券责令整改，给予警告，没收违法所得6,805,135.75 元，并处以20,415,407.25元罚款。。

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广发证券，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

2、海通证券

本组合投资的前十名证券之一海通证券股份有限公司（以下简称"海通证券"）于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）《行政处罚事先告知书》（处罚字【2015】73号）（以下简称《告知书》）。根据《告知书》，海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为。中国证监会对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以85,959,000元罚款。。

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海通证券，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

3、华泰证券

本组合投资的前十名证券之一华泰证券股份有限公司（以下简称"华泰证券"）于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）《行政处罚事先告知书》（处罚字【2015】72号）（以下简称《告知书》）。根据《告知书》，华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为。中国证监会对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所18,235,275.00元，并处以54,705,825.00元罚款。

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华泰证券，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

4、长江证券

本基金投资的前十名证券之一的长江证券股份有限公司（以下简称"长江证券"）于2015年5月6日受到中国证监会对长江证券相关研究报告的制作、审批和发布等情况的合规性核查。从检查情况看，媒体转载内容来源于5月4日长江证券发布的题为《上证成交可上1.4万亿，创业板已达巅峰——从交易成本看当前市场系列之二》的研究报告。检查中发现，长江证券未与转载机构签订协议，未明确转载责任，致使转载机构篡改了研究报告标题；研报报送审核人员不符合公司内部规定，未能严格执行其内部管理制度。上述行为反映出公司内部控制制度未能有效执行，并违反了中国证监会《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告[2010]28号）第二十一条，"证券公司、证券投资咨询机构授权其他机构刊载或者转发证券研究报告或者摘要，应当与相关机构作出协议约定，明确刊载或者转发责任"之规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告[2010]28号）第二十二条的规定，中国证监会对长江证券采取了出具警示函的行政监管措施。根据长江证券公告，长江证券已按照相关规定和中国证监会的要求，采取了措施，严格执行内部控制制度，加强研报刊载或者转发管理，确保业务开展依法合规。2016年1月，中国证监会湖北监管局（以下简称湖北证监局）下发了《关于对长江证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查的次数监管措施的决定》（[2016]1号），认为公司在开展研究报告业务时，存在内部控制不完善的情形，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条关于"证券公司应当按照审慎经营的原则，建立健全风险管理与内部控制制度，防范和控制风险"的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，湖北证监局责令长江证券在2016年2月1日至2017年1月31日期间，每3个月对公司研究报告业务增加一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日内向湖北证监局报送合规检查报告。2016年3月，中国证监会湖北监管局（以下简称湖北证监局）下发了《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》（[2016]3号），认为公司作为武汉四方交通物流有限责任公司（以下简称四方物流）2014年中小企业私募债项目的受托管理人，在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责，未按照《四方物流2014年中小企业私募债券受托管理协议》的约定，如实披露募集资金使用情况。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条关于"为公司债券发行提供服务的承销机构、资信评级机构、受托管理人、会计师事务所、资产评估机构、律师事务所等专业机构和人员应当勤勉尽责，严格遵守执业规范和监管规则，按规定和约定履行义务"的规定。按照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条的规定，湖北证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。

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长江证券，认为本次行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5、申万宏源

本组合投资的前十名证券之一申万宏源证券有限公司（以下简称"申万宏源证券"），于2015年11月6日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）行政监管措施决定书《关于对申万宏源证券有限公司采取暂停新开证券账户1个月措施的决定》（[2015]78号），具体内容如下：经查，申万宏源证券外部接入具有分账户功能的第三方交易终端软件，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。而且，在中国证监会下发《关于加强证券公司信息系统外部接入管理的通知》（证监办发[2015]35号）后，申万宏源证券在自查过程中存在向中国证监会漏报信息系统外部接入账户的情形。上述行为违反了《证券登记结算管理办法》第二十四条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条和《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，中国证监会责令申万宏源证券暂停新开证券账户1个月，暂停期间公司不得新增经纪业务客户。

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申万宏源证券，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

6、方正证券

本基金投资的前十名证券之一的方正证券股份有限公司（以下简称"方正证券"）于2015年7月14日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）《调查通知书》（湘证调查字0335号）。因公司涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规，证监会根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司立案调查。方正证券全资子公司中国民族证券有限责任公司（以下简称"民族证券"）及其相关高级管理人员于2015年7月24日分别收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称"北京证监局"）下发的《关于对中国民族证券有限责任公司采取限制业务活动、暂停核准业务申请以及谴责措施的决定》（【2015】48号）、《关于对中国民族证券有限公司董事长赵大建采取谴责措施的决定》（【2015】46号）、《关于对中国民族证券有限责任公司财务总监杨英采取谴责措施的决定》（【2015】47号）、《关于对中国民族证券有限责任公司合规总监蔡晓昕采取谴责措施的决定》（【2015】45号）和《关于对中国民族证券有限责任公司副总经理何东采取谴责措施的决定》（【2015】44号）。主要内容包括：一、按照《证券公司监督管理条例》第70条、《证券公司风险控制指标管理办法》第35条的规定，北京证监局对民族证券采取以下行政监管措施：1、暂停民族证券证券自营业务（固定收益证券自营除外）；2、暂停核准民族证券新业务的申请；3、对民族证券予以谴责。二、按照《证券公司监督管理条例》第70条的规定，北京证监局对民族证券董事长赵大建、财务总监杨英、合规总监蔡晓昕、副总经理何东均采取以下行政监管措施：通过北京证监局官方网站，对其予以谴责。方正证券于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）《行政处罚事先告知书》（处罚字【2015】74号）（以下简称《告知书》），根据《告知书》，公司未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项，《中国证券登记结算有限公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为。中国证监会对方正证券责令改正，给予警告，没收违法所得8,717,089.13元，并处以17,434,178.26元罚款。

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方正证券，认为本次行政监管措施对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。7、兴业证券

本基金投资的前十名证券之一的兴业证券股份有限公司（以下简称"兴业证券"）的控股子公司兴业全球基金管理有限公司（以下简称"兴全基金"）其全资子公司上海兴全睿众资产管理有限公司（以下简称"兴全睿众"）于2015年2月15日收到中国证券投资基金业协会下发的[2015]3号纪律处分决定书。纪律处分决定书认为兴全睿众旗下资产管理计划在参与大宗交易时存在异常情形，而未引起兴全基金足够警觉，也未向监管部门报告。经整改，兴全基金及兴全睿众对现有的特定客户资产管理计划业务进行了全面自查，对特定客户资产管理业务的制度建设、日常执行方面明确整改责任人和整改期限。

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，认为兴业证券是国内运作良好的证券公司，经营稳健，发展势头良好。兴业证券的自查报告显示，兴业证券母公司不存在受监管处罚情形，对兴业证券的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

7、兴业证券

本组合投资的前十名证券之一兴业证券股份有限公司（以下简称"兴业证券"）收到中国证券监督管理委员会福建证监局《关于对兴业证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查次数措施的决定》（以下简称"《决定》"）。《决定》内容显示，"2015年7月7日，你公司融资融券强制平仓操作出现差错，导致客户信用账户股票的实际强制平仓数量远超过应当平仓数量；7月8日，你公司未经客户同意直接在客户信用账户进行买回操作。你公司上述行为违反了《证券公司融资融券业务内部控制指引》（证监会公告〔2011〕32号）第十八条第一项和《关于加强证券经纪业务管理的规定》（证监会公告〔2010〕11号）第四条第二项的相关规定"。《决定》向兴业证券实施行政监管措施"责令你公司在2016年3月1日至2017年2月28日期间，每3个月对融资融券业务进行一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日内，向我局报送合规检查报告"。

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兴业证券，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

8、太平洋

本组合投资的前十名证券之一太平洋证券股份有限公司（以下简称"太平洋"）收到中国证券监督管理委员会云南监管局（以下简称"云南证监局"）于2016年1月22日做出的《关于对太平洋证券股份有限公司采取暂停新开证券账户1个月措施的决定》（〔2016〕1号），主要内容如下："公司温州瓯江路证券营业部个别经纪人涉嫌违规为客户间融资提供便利，公司内部检查时发现了该问题，但未能及时自纠，存在内部控制不完善情形。上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第三条、《中国证监会关于加强证券经济业务管理的规定》第三条和《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，云南证监局责令公司在2016年1月25日至2016年2月24日期间暂停新开证券账户1个月，暂停期间公司不得新增经纪业务客户。同时要求公司按照相应法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改，进一步梳理相关流程，强化有关人员合规守法意识"。

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太平洋，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，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）

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	1,556,685.86
2	应收证券清算款	35,941,918.24
3	应收股利	–
4	应收利息	19,759.48
5	应收申购款	2,809,898.87
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	40,328,262.45

（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）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

（7）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
2015年5月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日	–27.77%	2.65%	–32.63%	3.82%	4.86%	–1.17%
2016年1月1日至2016年3月31日	–14.05%	3.63%	–13.55%	3.63%	–0.50%	0.00%
自基金合同生效日至2016年3月31日	–37.92%	2.93%	–41.76%	3.76%	3.84%	–0.83%

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=中证全指证券公司指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%；

注2：本基金基金合同于2015年5月6日生效；

注3：本基金业绩截止日为2016年3月31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、基金合同生效后的标的指数许可使用费；

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、账户开户费用、账户维护费用；

10、基金的上市费和年费；

11、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。

（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1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00 %÷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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.22%÷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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

H＝E×0.02%÷当年天数

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足50,000元的，按50,000元计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前10 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒介公告。

上述"一、基金费用的种类中第4－11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）与基金销售有关的费用

1、基金份额的场外申购与赎回

（1）申购费用

本基金的场外申购费率随投资者申购金额的增加而减少。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金场外申购费率如下表：

申购金额M（元）	申购费率
M＜100万	1.20%
100万≤M＜500万	0.60%
M≥500万	每笔100元

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，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）赎回费用

本基金的场外赎回费率最高不超过赎回金额的0.50%，且随投资者持有基金份额期限的增加而减少。

本基金场外赎回费率如下表（1年为365日）：

持有年限Y	赎回费率
Y＜1年	0.50%
1年≤Y＜2年	0.25%
Y≥2年	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

（3）基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（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，针对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，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。

2、基金份额的场内申购与赎回

（1）申购费用

本基金的场内申购费率自2015年9月21日起进行调整，调整后费率如下表。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

基金场内申购费率：

申购金额M（元）	申购费率
M＜500万	0
M≥500 万	按笔收取，每笔100 元

申购费用由投资者承担，在申购基金份额时收取，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）赎回费用

本基金的场内赎回费率为固定费率0.50%，不按持有期限设置分段赎回费率。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

（3）基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（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，针对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，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。

（四）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；

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。

（五）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。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

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、在"重要提示"部分明确了更新招募说明书内容的截止日期和有关财务数据的截止日期。

2、对"三、基金管理人"部分内容进行了更新。

3、对"四、基金托管人"部分内容进行了更新。

4、对"五、相关服务机构"内容进行了更新。

5、对"十、基金份额的申购与赎回"部分内容进行了更新。

6、更新了"十三、基金的投资"投资组合报告内容，披露截止至2016年3月31日的数据。

7、对"十四、基金的业绩"部分内容进行了更新。

8、对"二十七、其他应披露事项"内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司

2016年6月

证券代码：000819　　证券简称：岳阳兴长　　公告编号：2016-019

岳阳兴长石化股份有限公司2015年度分红派息、转增股本实施公告

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。

岳阳兴长石化股份有限公司(以下简称"公司")2015年度利润分配方案已经2016年4月27日公司第四十七次(2015年度)股东大会审议通过。现将权益分派事宜公告如下：

一、股东大会审议通过利润分配及资本公积金转增股本方案等情况

1、公司第四十七次(2015年度)股东大会审议通过的2015年度利润分配方案为：以公司总股本246,111,657股为基础，向全体股东每10股派发现金红利0.50元(含税)，同时以资本公积金向全体股东每10股转增0.5股。

2、本次实施的利润分配方案与股东大会审议通过的方案一致。

3、自2015年度权益分派方案披露至实施期间，公司股本总额未发生变化。

4、本次实施分配方案距离股东大会审议通过未超过两个月。

二、本次实施的利润分配及资本公积金转增股本方案

公司本次权益分派方案为：以公司总股本246,111,657股为基础，向全体股东每10股派0.50元人民币现金(含税；扣税后，QFII、RQFII以及持有股改限售股、首发限售股的个人和证券投资基金每10股派0.45元人民币现金；持有非股改、非首发限售股及无限售流通股的个人、证券投资基金股息红利税实行差别化税率征收，先按每10股派0.50元，权益登记日后根据投资者减持股票情况，再按实际持股期限补缴税款a；对于QFII、RQFII外的其他非居民企业，本公司未代扣代缴所得税，由纳税人在所得发生地缴纳。)；同时，以资本公积金向全体股东每10股转增0.5股，共计转增12,305,582股。

[a注：根据先进先出原则，以投资者证券账户为单位计算持股期限，持股1个月(含1个月)以内，每10股补缴税款0.10元；持股1个月以上至1年(含1年)的，每10股补缴税款0.05元；持股超过1年的，不需要补缴税款。]

本次分红派息、转增股本实施前本公司总股本为246,111,657股，实施后总股本增至258,417,239股。

三、分红派息日期

本次权益分派股权登记日：2016年6月22日

除权除息日：2016年6月23日

本次转增股份的无限售流通股上市日(红利发放日)：2016年6月23日

四、分红派息对象

本次分红派息对象为：截止2016年6月22日下午深圳证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司(以下简称"中国结算深圳分公司")登记在册的本公司全体股东。

五、分配、转增股本方法

1、公司此次转增的股份将于2016年6月23日直接计入股东证券账户。在转增过程中产生的不足1股的部分，按小数点后尾数由大到小排序依次向股东派发1股(若尾数相同时则在尾数相同者中由系统随机排序派发)，直至实际转增股总数与本次转增股总数一致。

2、公司此次委托中国结算深圳分公司代派的现金红利将于2016年 6月23日通过股东托管证券公司(或其他托管机构)直接划入其资金账户。

若投资者在除权日办理了转托管，其红利及转增股在原托管证券商处领取。

3、以下A股股东的现金红利由公司自行派发：

序号	股东账号	股东名称
1	08*****529	中国石化集团资产经营管理有限公司
2	08*****747	湖南长炼兴长集团有限责任公司

由公司自行派发红利的股东账户中，湖南长炼兴长集团有限责任公司的持股数包含其通过财富证券有限责任公司定向资产管理计划持有的公司股票。

在权益分派业务申请期间（申请日2016年6月14日至登记日2016年6月22日），如因自派股东证券账户内股份减少而导致委托中国结算深圳分公司代派的现金红利不足的，一切法律责任与后果由我公司自行承担。

六、股份变动结构表

股份类型	资本公积金转增股本前		本次变动数	资本公积金转增股本后	
	数量	比例(%)		数量	比例(%)
一、有限售条件股份	17,969	0.01	898	18,867	0.01
高管持股	17,969	0.01	898	18,867	0.01
二、无限售条件股份	246,093,688	99.99	12,304,684	258,398,372	99.99
人民币普通股	246,093,688	99.99	12,304,684	258,398,372	99.99
股份总数	246,111,657	100	12,305,582	258,417,239	100

七、本次实施转增后，按新股本258,417,239股摊薄计算，公司2015 年度每股收益为0.188元。

八、咨询机构

咨询地址：湖南省岳阳市岳阳大道岳阳兴长大厦10楼

咨询联系人：秦剑夫

咨询电话：0730－8829751

传真电话：0730－8829752

九、备查文件

1、公司第四十七次(2015年度)股东大会决议；

2、中国结算深圳分公司确认有关分红派息、转增股本具体时间安排的文件；

3、深交所要求的其他文件。

特此公告。

岳阳兴长石化股份有限公司

董事会

二〇一六年六月十四日

泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第三十六次风险提示公告

依据《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称"基金合同"）的相关约定，当泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金（以下简称"本基金"）之泰信基本面400B份额（场内简称：泰信400B、代码：150095）的基金份额参考净值达到0.250元时，本基金将分别对泰信基本面400A份额（场内简称：泰信400A、代码：150094）、泰信基本面400B份额（场内简称：泰信400B、代码：150095）和泰信基本面400份额（场内简称：泰信400、代码：162907）进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截止2016年6月14日，泰信400B基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阀值0.250元，在此提请投资者密切关注泰信400B份额近期参考净值的波动情况。

针对不定期折算可能带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、泰信400A份额表现出低风险、收益稳定特征。当发生合同规定的上述不定期份额折算时，原泰信400A份额持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的低风险收益特征份额变为同时持有低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。此外，泰信400份额为跟踪中证锐联基本面400指数的基础份额，其份额净值随市场涨跌而变化，因此原泰信400A份额持有人可能会承担市场下跌而遭受损失的风险。

二、泰信400B份额表现出高风险、高收益的特征。不定期折算后，杠杆倍数将降低，恢复到初始的2倍杠杆水平。相应的，泰信400B份额净值随市场涨跌而增长或下降的幅度也会相应减小。

三、泰信400A份额、泰信400B份额在不定期折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后，其折溢价可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

四、根据合同规定，折算基准日在触发阀值日后才能确定，因此折算基准日泰信400B份额的净值可能与触发折算阀值的0.250元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

依据深圳证券交所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有较少泰信400份额、泰信400A份额、泰信400B份额的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停泰信400A份额与泰信400B份额的上市交易和泰信400份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅基金合同及《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话：400－888－5988 021－38784566。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

特此公告。

泰信基金管理有限公司

2016年6月15日

证券代码：000150　　证券简称：宜华健康　　公告编号：2016-49

宜华健康医疗股份有限公司关于公司股东部分股票解除质押及进行股票质押式回购交易的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

公司近日接到控股股东宜华企业（集团）有限公司（以下简称"宜华集团"）的告知函，获悉宜华集团将所持有本公司的部分股份解除质押及重新办理质押式回购交易，具体事项如下：

一、股东股份解除质押的基本情况

近日，宜华集团将原质押给平安证券有限责任公司28,000,000股公司股份、中信证券股份有限公司5,000,000股公司股份及上海海通证券资产管理有限公司40,000,000股公司股份购回，并办理了相关质押解除手续。

二、股东股份被质押的基本情况

近日，宜华集团将持有公司37,100,000股股份质押给平安证券有限责任公司，及将持有37,100,000股公司股份质押给财富证券有限责任公司，办理股票质押式回购交易业务，期限为一年。上述质押股份占宜华集团所持公司股份总数的45.92%，占公司总股本的16.57%。

三、股东股份累计被质押的情况

截止本公告日，宜华集团持有公司股份161,572,045股，占公司总股本的 36.08%，其中处于质押状态的股份累计数为104,340,000股，占公司总股本的 23.30%。

四、备查文件

宜华集团告知函

特此公告。

宜华健康医疗股份有限公司董事会

二〇一六年六月十四日

证券代码：600247　　证券简称：ST成城　　编号：2016-026

吉林成城集团股份有限公司关于收到上海证券交易所对公司有关年报事项的问询函的公告

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。

吉林成城集团股份有限公司（以下简称"公司"）于2016年6月14日收到上海证券交易所上证公函【2016】0754号《关于对吉林成城集团股份有限公司有关年报事项的问询函》（以下简称"《问询函》"），根据上海证券交易所相关规定，现将《问询函》全文公告如下：

"吉林成城集团股份有限公司：

2016年6月1日，你公司披露了《对上海证券交易所对公司 2015 年年度报告事后审核问询函的回复公告》（以下简称"回复公告"）。根据你公司的回复内容，现有如下问题，需你公司进一步核实并补充披露。

一、据回复公告，对于深圳中技、湖南成城精密、大陶精密科技等债务人需向公司承担的违约金 4,196.42万元，你公司将其确认为2015年营业外收入。其中，大陶精密科技和湖南成城精密尚未偿还公司本金 70,859,702.20元，该部分本金所对应的违约金为1145.28万元亦在确认范围。对此，请公司说明，在本金尚未收回的前提下，将相应收款作为违约金确认为营业外收入，是否符合会计处理的谨慎性原则和会计准则的相关规定。请会计师发表意见。

二、据回复公告，公司对武汉晋昌源经贸有限公司的担保金额 3.31亿元以及对天津晟普祥商贸有限公司的担保金额0.5亿元，分别于2015年9月、7月到期。对于该逾期担保事项，公司未计提相应预计负债。请公司说明相关会计处理是否符合会计处理的谨慎性原则和会计准则的相关规定。请会计师发表意见。

请公司于2016年6月20日前，就上述事项予以披露，并以书面形式回复我部。"

公司将根据《问询函》中所涉及的相关问题及时间要求，及时予以回复并履行信息披露义务。

特此公告。

吉林成城集团股份有限公司董事会

2016年6月15日

证券代码：603919　　证券简称：金徽酒　　公告编号：临2016-015

金徽酒股份有限公司关于重大事项继续停牌的公告

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。

金徽酒股份有限公司（以下简称"公司"）正在筹划重大事项，可能构成重大资产重组。公司于2016年6月6日申请紧急停牌，2016年6月7日发布了《关于重大事项停牌的公告》（公告编号：临2016-014）。停牌期间，公司与相关方就重大事项进行了沟通，并达成初步意向，同意继续推动重大事项进展。

鉴于该重大事项仍在筹划当中，公司与相关方还未签署正式协议文件，该事项尚存在重大不确定性，为保证公平信息披露，避免造成公司股价异常波动，维护投资者利益，根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定，经向上海证券交易所申请，公司股票自2016年6月15日（星期三）开市起继续停牌。

停牌期间，公司将积极与相关方推进重大事项进展，并及时履行信息披露义务，将于本次股票停牌之日起的5个交易日内确定是否进入重大资产重组程序。

公司郑重提醒广大投资者，有关公司信息以公司在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）和法定信息披露媒体《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》刊登的相关公告为准，敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

金徽酒股份有限公司董事会

2016年6月15日

证券代码：002592　　证券简称：八菱科技　　公告编号：2016-78

南宁八菱科技股份有限公司关于公司股东股份解除质押的公告

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、误导性陈述或重大遗漏。

南宁八菱科技股份有限公司（以下简称"公司"）接到公司股东杨竞忠先生的通知，获悉其杨竞忠先生质押给东吴证券股份有限公司的5,000,000 股（占公司总股本 1.76%）公司股份已办理了提前购回业务，并已在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完成股份解除质押登记手续，具体事项如下：

一、股份解除质押情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数（股）	质押开始日期	解除质押日	质权人	本次解除质押占其所持股份比例
杨竞忠	是	5,000,000	2015-12-18	2016-06-13	东吴证券股份有限公司	5.28%

截止本公告日，杨竞忠持有公司94,766,049股股份，占公司总股本的33.45%，其中办理了股票质押式回购交易的股份为76,000,000股，占公司总股本的26.82%。

二、备查文件

1、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细；

特此公告。

南宁八菱科技股份有限公司

董事会

2016年6月15日