（上接B18版）

104 上海云湾投资管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人：戴新装
联系人：江辉
电话：021-20538888
传真：021-20538999
客服电话：400-820-1515
网址：www.zhengtongfunds.com
105 弘业期货股份有限公司
注册地址：南京市秦淮区中华路50号
办公地址：南京市秦淮区中华路50号弘业大厦2-10楼
法定代表人：周剑秋
联系人：孙朝旺
电话：025-52278870
传真：025-52250114
客服电话：4008281288
网址：www.ftol.com.cn
106 本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告
3.1.2 场内销售机构
场内销售机构是指具有基金代销业务资格、并经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关证券交易所会员单位，具体名单以交易所网站刊载内容为准。
3.2 登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：崔巍
电话：010-50938856
传真：010-59378907
3.3 出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
联系人：黎明
电话：（86 21）3135 8666
传真：（86 21）3135 8600
经办律师：黎明、孙睿
3.4 审计基金财产的会计师事务所
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：薛竞、陈熹

§4 基金名称

南方中证高铁产业指数分级证券投资基金

§5 基金的类型

股票型证券投资基金

§6 基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。

§7 基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（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（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经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。
基金的投资组合比例为：
本基金80%以上的基金资产投资于股票，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

§8 基金的投资策略

8.1 投资策略
本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的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。
（一）资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用指数复制法，按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。
（二）股票投资策略
本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。
1、股票投资组合的构建
本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。特殊情况下，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。
2、股票投资组合的调整
（1）定期调整
本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。
（2）不定期调整
1）当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；
2）根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；
3）特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占有的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。
上述释殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股长期停牌；③标的指数成份股流动性严重不足；④成份股上市公司存在重大违规行为，有可能面临重大的处罚或诉讼。
（三）债券投资策略
在选择债券品种时，首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。
（四）权证投资策略
本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。
基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。
（五）股指期货等投资策略
本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
8.2 投资决策依据和决策程序
1、决策依据
有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。
2、投资管理体制
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有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。基金管理人有权根据基金运作情况选择、更换或撤销境外投资顾问，为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务。
3、投资程序
研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。
（1）研究支持：指数化投资团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为、股指期货跟踪有效性等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。
（2）投资决策：投资决策委员会依据指数化投资团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。
（3）组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。
（4）交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。
（5）投资绩效评估：指数化投资团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此调整投资组合。
（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，紧密跟踪标的指数。
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环境变化和实际需要对上述投资体制和程序做出调整，并在更新的《招募说明书》中列示。

§9 基金业绩比较基准

本基金的标的指数：中证高铁产业指数及其未来可能发生的变更。
本基金的业绩比较基准：标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

§10 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
从本基金所分析的两类基金份额来看，高铁A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；高铁B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

§11 基金投资组合报告

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。
基金托管人根据本基金合同规定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。
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。
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。
本投资组合报告所载数据截至2016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	158,670,532.50	94.41
	其中：股票	158,670,532.50	94.41
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	9,208,817.22	5.48
8	其他资产	177,232.06	0.11
9	合计	168,056,581.78	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	100,156,374.85	60.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	54,458,757.01	32.65
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	3,676,921.00	2.20
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	158,292,052.86	94.90

2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	178,603.02	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	44,161.08	0.03
F	批发和零售业	12,918.69	0.00
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	94,537.68	0.06
J	金融业	48,239.17	0.03
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	378,479.64	0.23

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	601390	中国中铁	3,309,517	23,365,190.02	14.01
2	601766	中国中车	2,498,528	22,386,810.88	13.42
3	601186	中国铁建	2,314,696	20,855,410.96	12.50
4	600820	隧道股份	1,054,393	10,238,156.03	6.14
5	002501	利源精制	510,400	5,854,288.00	3.51
6	300001	特锐德	268,840	5,452,075.20	3.27
7	000008	神州高铁	554,900	5,376,981.00	3.22
8	600967	北方创业	441,500	5,161,135.00	3.09
9	600169	太原重工	1,138,101	4,575,166.02	2.74
10	002480	新筑股份	346,300	4,494,974.00	2.69

3.2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	300541	先进数通	1,230	55,928.10	0.03
2	603067	振华股份	2,172	54,690.96	0.03
3	300534	陇神戎发	920	51,547.60	0.03
4	600908	无锡银行	2,625	27,221.25	0.02
5	300542	新晨科技	988	25,016.16	0.01

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
9.1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投资股指期货。
9.2本基金投资股指期货的投资政策
本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注：本基金本报告期内未投资国债期货。
11.投资组合报告附注
11.1
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。
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。
11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,837.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,950.55
5	应收申购款	151,444.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	177,232.06

11.4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。
11.5报告期末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。
11.5.2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。

§12 基金业绩

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。

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）
2015.6.10-2015.12.31	-26.98%	3.51%	-38.20%	3.46%	11.22%	0.05%
2016.1.1-2016.9.30	-23.21%	2.14%	-25.15%	2.10%	1.94%	0.04%
自基金成立起至今	-43.93%	2.81%	-53.74%	2.76%	9.81%	0.05%

§13 基金的费用概览

13.1 与基金运作有关的费用
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、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用许可费；
4、基金上市费用及年费；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券/期货交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、基金相关账户的开户及维护费用；
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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.0%÷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、公休日等，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5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。
3、基金合同生效后标的指数许可使用费
本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法支付指数使用许可费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年指数使用费率÷当年天数，本基金年指数使用费率为0.02%
H为每日应计提的指数使用费
E为前一日的基金资产净值
基金合同生效后的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币50,000元，计费区间不足一季度的，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基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每一季度末结束后的10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。
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、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。
四、费用调整
基金管理人可以根据与基金份额持有人利益一致的原则，结合产品特点和投资人的需求设置基金管理费率的结构和水平。
基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调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。除根据法律法规要求提高该等报酬标准以外，提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
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。
13.2 与基金销售有关的费用
申购费用和赎回费用
1、本基金场外申购费率最高不高于0.6%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

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

本基金基础份额的场内申购费率为0。
投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计算。
申购费用由投资人承担，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、本基金场外赎回费率不高于0.5%，随申请份额持有时间增加而递减（其中1年为365天）。具体如下表所示：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

本基金场内赎回费率为0.5%。
投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，南方高铁份额的赎回费用在基金份额持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。
3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并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上公告。
4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

§14 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他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，对本基金的原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，对“重要提示”进行了更新。
2、在“基金管理人”部分，对“基金管理人概况”进行了更新，对“主要人员情况”进行了更新。
3、在“基金托管人”部分，对“基金托管人”进行了更新。
4、在“相关服务机构”部分，对“销售机构”进行了更新。
5、在“基金的投资”部分，对“基金投资组合报告”进行了更新，对“基金业绩”进行了更新。
6、在“基金份额持有人服务”部分，对“基金份额持有人服务”进行了更新。
7、在“其他应披露事项”部分，对“其他应披露事项”进行了更新。
8、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理有限公司
2017年1月13日

关于鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金开放申购和赎回业务的公告

公告送出日期：2017年1月13日

1公告基本信息

基金名称	鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金
基金简称	鹏华丰融定期开放债券
基金主代码	000345
基金运作方式	契约型，本基金采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。本基金自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起一年的期间封闭运作，不办理申购与赎回业务，也不上市交易。 本基金自封闭期结束之后第一个工作日（含）起进入开放期，每个开放期原则上不少于五个工作日，不超过二十个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。
基金合同生效日	2013年11月19日
基金管理人名称	鹏华基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
基金份额登记机构名称	鹏华基金管理有限公司
公告依据	《鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其更新（以下简称“招募说明书”）
申购起始日	2017年1月16日
赎回起始日	2017年1月16日

2 日常申购、赎回业务的办理时间
鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）自2017年1月16日起（含当日）进入开放期，其中申购开放时间为2017年1月16日至2017年2月17日，在此期间接受投资者的申购业务申请；赎回开放时间为2017年1月16日至 2017 年1月 20日，在此期间接受投资者的赎回业务申请。
3 日常申购业务
3.1 申购金额限制
投资人通过销售机构申购本基金，单笔最低申购金额为10元（含申购费）。通过基金管理人直销中心申购本基金，首次最低申购金额为50万元，追加申购单笔最低金额为1万元（通过本基金管理人基金网上交易系统等特定交易方式申购本基金暂不受此限制）。各销售机构可根据业务情况设置高于或等于本公司设定的上述单笔申购最低金额，如果销售机构业务规则规定的最低单笔申购金额高于10元人民币，以销售机构的规定为准。投资者办理相关业务时，请遵循销售机构的具体业务规定。基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。
3.2 申购费率
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适用下表特定申购费率，其他投资人申购本基金基金份额的适用下表一般申购费率：

申购金额（M）	申购费率	特定申购费率
M<100万元	0.60%	0.24%
100万元≤M<500万元	0.30%	0.09%
500万元≤M	1000元/笔	1000元/笔

注：1、本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。
2、申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。
3、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人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等，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人。
4 日常赎回业务
4.1 赎回份额限制
投资人赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；账户最低余额为5份基金份额，若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的单只基金份额余额不足5份时，该笔赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，剩余部分的基金份额将被强制赎回。基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。
4.2 赎回费率

持有期限（Y）	赎回费率
N<1个封闭期	0.75%
1个封闭期≤N	0

注：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。赎回费总额的100%归入基金财产。
5 基金销售机构
5.1直销机构
鹏华基金管理有限公司直销中心，包括本公司设在深圳、北京、上海、武汉、广州的直销中心。
办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
网址：www.phfund.com
全国统一客服务电话：400-6788-999
5.2 其他销售机构
1、银行销售机构：交通银行、招商银行、吉林银行、邮储银行、东莞农商银、顺德农商行、张家港农商行、民生银行、平安银行、中信银行、江南农商行、徽商银行、福建海峡银行。
2、券商销售渠道：国信证券、长城证券、华西证券、光大证券、湘财证券、信达证券、安信证券、申万宏源证券、中投证券、广州证券、中信建投 、海通证券、长江证券、方正证券、华鑫证券、中金公司、天风证券、西南证券、开源证券、第一创业证券、民族证券、华融证券、中信建投期货、平安证券。
3、第三方销售机构：深圳众禄、诺亚正行、杭州数米、天相投顾、上海长量、好买基金、展恒基金、同花顺、上海天天基金、金观诚财富、和讯信息、深圳新兰德、宜信普泽、泛华普益、中期时代、众升财富、恒天明泽、上海汇付、乐融多源、盈米财富、上海陆金所、苏宁基金、蛋卷基金、北京汇成基金、北京肯特瑞财富、北京增财基金。
6 基金份额净值公告/基金收益公告的披露安排
在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。
7 其他需要提示的事项
1、本基金的封闭期为自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起一年，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。
2、一般情况下，本基金的开放期为自封闭期结束之日后第一个工作日（含）起原则上不少于五个工作日、不超过二十个工作日的期间，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作方式，投资人可办理基金份额的申购、赎回或其他业务，开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。
3、如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。
4、本公告仅对本基金本次开放申购、赎回业务的有关事项予以说明。投资人欲了解本基金相关业务规则的详细情况，请阅读刊登在中国证券监督管理委员会指定信息披露媒介上的《鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其更新，或登陆本基金管理人网站（www.phfund.com）查询，并以此为准。
风险提示：本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。请投资人投资本基金前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书（更新），并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资人注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司
2017年1月13日

证券代码：600256　证券简称：广汇能源　公告编号：2017-001

广汇能源股份有限公司 2016年第四季度主要运营数据公告

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。
一、运营数据：

产品	计量单位	类别	2016第四季度		自年初累计	
			数值	同比增减幅（%）	数值	同比增减幅（%）
甲醇	万吨	产量	28.99	27.88	107.67	50.59
	万吨	销量	27.80	32.82	108.73	53.57
天然气	万方	产量	29,409.29	41.57	108,920.58	48.79
	万方	销量	35,176.85	37.56	122,652.42	24.13
煤炭	万吨	产量	237.12	13.66	766.07	2.52
	万吨	销量	120.08	41.64	255.32	-50.62
煤化工副产品	万吨	产量	7.97	8.14	32.86	12.23
	万吨	销量	7.27	-8.78	33.73	14.92

二、简要说明：
2016年第四季度公司甲醇、LNG、煤炭等主要产品的产销量与上年同期相比情况如下：
1. 煤化工产品：2016年，哈密新能源公司坚持以工作高标准和创新驱动为抓手，工厂节能技改成效显著，产品产量屡创新高，装置首次实现年度达标超产。全年各项产品产销量较上年同期相比均大幅增长，其中：甲醇产销量分别增长50.59%、53.57%；副产品产销量分别增长12.23%、14.92%。第四季度，甲醇产销量较上年同期相比增长明显，涨幅分别为：27.88%、32.82%；副产品产量较上年同期增长8.14%，销量较上年同期下降8.78%。
2. LNG产品：2016年，天然气公司逆势前行，适时调整营销策略，产运销持续发展，全年LNG产销量较上年同期分别增长48.79%、24.13%。第四季度，吉木乃LNG工厂进气量和出成率持续保持高位，哈密新能源工厂通过技改实现达标超产，LNG单季度整体产销量较上年同期大幅增长，涨幅分别为41.57%、37.56%。
3. 煤炭产品：2016年第四季度，公司紧抓煤炭价格回暖的机遇，实现单季煤炭产量较上年同期增长13.66%，销量较上年同期增长41.64%。但全年受销售区域萎缩，重点客户竞价激烈，淖毛湖周边兰炭厂大面积停产等不利因素影响，销量较上年同期下降50.62%。
三、风险提示：
上述主要运营数据源自公司内部统计，运营数据在季度