（上接B54版）

（95）名称：万银财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人：李招弟
联系人：高晓芳
联系电话：010-59393923
业务传真：010 -59393074
客服热线：400-808-0069
公司网址：www.wy-fund.com
（96）名称：太平洋证券股份有限公司
注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元
法定代表人：李长伟
联系人：陈钰
联系电话：010-88321882
业务传真：010-88321763
客服热线：0871-68898130
公司网址：www.tpyzq.com
（97）名称：上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021-54509998
业务传真：021-64385308
客服热线：4001818188
公司网址：www.1234567.com.cn
（98）名称：杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：张裕
联系电话：021-60897840
业务传真：0571-26697013
客服热线：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn
（99）名称：和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：吴阿婷
联系电话：0755-82721106-8642
业务传真：0755-82029055
客服热线：4009200022
公司网址：www.hexun.com
（100）名称：浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欣美中心1号楼（D区）801室
办公地址：浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欣美中心1号楼（D区）801室
法定代表人：陆彬彬
联系人：邓秀男
联系电话：0571-56028620
业务传真：0571-56899710
客服热线：400 068 0058
公司网址：www.jincheng-fund.com
（101）名称：东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层（详细地址）
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层（详细地址）
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
联系电话：010-66555316
业务传真：010-66555246
客服热线：4008888993
公司网址：www.dxzq.net.cn
（102）名称：上海久富财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区莱阳路2819号1幢109室
办公地址：上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人：赵惠蓉
联系人：徐金华
联系电话：021-68685825
业务传真：021-68682297
客服热线：400-021-9898
公司网址：www.jfcta.com
（103）名称：大同证券经纪有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
联系电话：0351-4130322
业务传真：0351-4137986
客服热线：4007121212
公司网址：www.dtsbc.com.cn
（104）名称：北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁越
联系人：陈筝
联系电话：010-57756019
业务传真：010-57756199
客服热线：400-786-8868-5
公司网址：www.chtfund.com
（105）名称：嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：景琪
电话：021-20289890
传真：021-20280110
网址：www.harvestwm.cn
客服电话：400-021-8850
（106）名称：一路财富(北京)信息科技有限公司
公司简称：一路财富
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
联系电话：010-88312877-8009
业务传真：010-88312099 客服热线：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com
（107）名称：中信建投期货有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
联系人：刘芸
联系电话：023-86769637
业务传真：023-86769629
客服热线：400-8877-780
公司网址：www.cfc108.com.cn
（108）名称：海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼
法定代表人：刘惠
联系人：刘艳妮
联系电话：021-80133827
业务传真：021-80133413
客服热线：400-808-1016
公司网址：www.fundhaiyin.com
（109）名称：北京恒益基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民链大厦6层
法定代表人：付振杰
联系人：崔飞飞
联系电话：010-52703350-6006
业务传真：010-62020355
客服热线：4008886661
公司网址：www.myfund.com
（110）名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
联系电话：010-52855713
业务传真：010-85894285
客服热线：400-6099-200
公司网址：www.yixinfund.com
（111）名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
法定代表人：杨懿
联系人：张燕
联系电话：010-58325388-1588
业务传真：010-58325282
客服热线：400-166-1188
公司网址：http://8.jrj.com.cn
（112）名称：上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服电话：4000-466-788
公司网址：www.66zichan.com
（113）名称：珠海证米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629019
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn
（114）名称：上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7-9层
法定代表人：冯修敏
联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611
传真：021-33323837
客服电话：400-820-2819
公司网址：https://tty.chinapnr.com
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（二）场内发售机构
具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所相关规定的深圳证券交易所会员单位（具体名单见深交所网站 http://www.szse.cn/main/marketdata/tjsj/jypm/memberlist/）。
二、注册登记机构
名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
法定代表人：王志伟
联系人：李尔华
电话：020-89188970
传真：020-89899175
三、律师事务所和经办律师
名称：国浩律师（广州）事务所
住所：广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层负责人：程秉
电话：020—38799345
传真：020—38799335
经办律师：黄贞、陈桂华
联系人：程秉
四、会计师事务所和经办注册会计师
德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表：卢伯卿
电话：021—61418888
传真：021—63350003
经办注册会计师：王明静、吴迪

第四部分 基金的名称

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金链接基金

第五部分 基金的类型

交易型开放式

第六部分 基金的投资目标

本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，持有现金或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%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（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。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

第八部分 基金的投资策略

一、投资策略：

本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

（一）资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股、备选成份股，其中投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

（二）目标ETF投资策略

1、投资组合的投资方式

在基金的日常投资管理中，本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和赎回目标ETF的基金份额，实现指数化投资目标。同时，本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标ETF基金份额。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。

2、投资组合的调整

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）当净申购时，本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）当净赎回时，本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。

（三）股票投资策略

1、股票组合构建原则

根据标的指数、结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。

3、股票组合的调整

（1）定期调整

本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

（四）债券投资策略

本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。

（五）股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，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。

本基金运用股指期货的情形主要包括：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；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

二、投资决策依据和决策程序

1、决策依据

以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资决策程序。严格的投资决策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：数量投资部依托公司整体研究平台，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、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析，目标ETF二级市场的流动性和折溢价分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：基金投资委员会依据数量投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。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，基金经理构建以目标ETF为主的投资组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）绩效评估：绩效评估与风险管理组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整：基金经理将跟踪目标ETF及标的指数的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金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等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

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程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金以中证500指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为：95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为ETF联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

第十一部分 基金的投资组合报告

广发基金管理有限公司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，并对本报告内容的真实性、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根据本基金基金合同规定，于2015年12月16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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,115,335.00	0.08
	其中：股票	1,115,335.00	0.08
2	基金投资	1,309,727,326.33	94.20
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	77,930,609.21	5.61
8	其他各项资产	1,595,765.45	0.11
9	合计	1,390,369,035.99	100.00

2.期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	广发中证500	股票型	交易型开放式	广发基金管理有限公司	1,309,727,326.33	94.42

3. 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	832,077.00	0.06
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	1,128.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	90,180.00	0.01
H	住宿和餐饮业	86,670.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	83,650.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	21,630.00	0.00
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	1,115,335.00	0.08

4. 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	600654	飞乐股份	9,200	182,804.00	0.01
2	600787	中储股份	9,000	90,180.00	0.01
3	600978	宜华木业	6,000	88,980.00	0.01
4	600499	科达洁能	3,000	88,920.00	0.01
5	600754	锦江股份	3,000	86,670.00	0.01
6	600482	风帆股份	2,000	84,760.00	0.01
7	600643	爱建股份	5,000	83,650.00	0.01
8	600110	中科英华	6,000	82,380.00	0.01
9	600879	航天电子	4,000	63,680.00	0.00
10	600160	巨化股份	4,500	55,305.00	0.00

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金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五名债券投资明细
本基金报告期末未持有债券。

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。

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贵金属投资明细
本基金报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-9,209,960.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金报告期末未持有国债期货。

（2）本基金报告期内未进行国债期货交易。

12. 投资组合报告附注

（1）根据安徽皖江物流（集团）股份有限公司（股票代码：600575）2014年10月11日发布的《安徽皖江物流（集团）股份有限公司关于被中国证券监督管理委员会立案调查的公告》显示，因公司涉嫌信息披露违法违规，被中国证券会进行立案调查。

本基金对该股票的投资逻辑是：第一，皖江物流的子公司淮矿物流已停止经营、相关债务债权已经剥离上市公司，且钢铁价格很难进一步大幅下跌，预计不会有更多的债务风险暴露。第二，皖江物流绝对控股股东为安徽省属国有独资企业淮南矿业，是其旗下唯一上市平台，控股股东会竭尽全力处理公司的危机。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

（2）报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）本基金其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	882,866.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,313.94
5	应收申购款	692,824.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	5,760.00
9	合计	1,595,765.45

（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	600654	飞乐股份	182,804.00	0.01	重大事项
2	600978	宜华木业	88,980.00	0.01	重大事项
3	600499	科达洁能	88,920.00	0.01	重大事项
4	600754	锦江股份	86,670.00	0.01	重大事项
5	600482	风帆股份	84,760.00	0.01	重大事项
6	600643	爱建股份	83,650.00	0.01	重大事项
7	600110	中科英华	82,380.00	0.01	重大事项

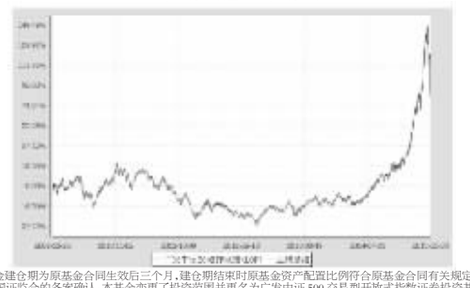
第十二部分 基金的业绩

本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。基金业绩数据截至2015年6月30日。

1.净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

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)
2009.11.26-2009.12.31	0.90%	0.67%	-0.56%	2.06%	1.46%	-1.39%
2010.01.01-2010.12.31	8.52%	1.71%	9.57%	1.72%	-1.05%	-0.01%
2011.01.01-2011.12.31	-32.51%	1.42%	-32.10%	1.45%	-0.41%	-0.03%
2012.1.1-2012.12.31	0.14%	1.43%	0.30%	1.46%	-0.16%	-0.03%
2013.1.1-2013.12.31	15.76%	1.36%	16.08%	1.37%	-0.32%	-0.01%
2014.1.1-2014.12.31	35.10%	1.18%	37.09%	1.18%	-1.99%	0.00%
2015.1.1-2015.6.30	63.45%	2.21%	63.97%	2.17%	-0.52%	0.04%
自基金合同生效起至今	89.17%	1.51%	92.72%	1.54%	-3.55%	-0.03%

2.自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
自原基金合同生效以来
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2009年11月26日至2015年6月30日）



注：原基金建仓期为原基金合同生效后三个月，建仓期结束时原基金资产配置比例符合原基金合同有关规定。经2013年10月10日中国证监会的备案确认，本基金变更了投资范围并更名为广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）。本基金自2013年10月10日起3个月内为建仓期（原持有的广发中证500指数成份股、备选成份股调整为广发中证500ETF），建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同有关规定。

第十三部分 基金的费用

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
本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.50%年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.50%÷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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则E取0
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
本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.10%年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.10%÷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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则E取0
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、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、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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个工作日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，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“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关信息。
2、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息。
3、在“第五部分 相关服务机构”部分，增加了相关的代销机构并对原有销售机构的资料进行更新，相关事宜均已公告。
4、在“第十部分 基金的投资”部分，补充了截至2015年6月30日的投资组合报告。
5、在“第十一部分 基金的业绩”部分，补充了截至2015年9月30日的基金业绩。
6、根据最新公告，对“第二十四部分 其他应披露事项”内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一五年十二月二十五日

股票简称：高升控股　股票代码：000971　公告编号：2015-146号

高升控股股份有限公司2015年第四次临时股东大会决议公告

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。

一、会议召开情况
（一）召集人：公司第八届董事会。
（二）现场会议召开时间：2015年12月24日下午14:30。
（三）现场会议召开地点：北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心B座9层。
（四）会议召开方式：现场投票和网络投票。
（五）会议主持人：董事长韦振宇。
（六）会议的召集、召开符合《公司法》、《上市公司股东大会规则》和《公司章程》的有关规定。

二、会议出席情况
出席会议的股东及股东授权委托代表31人，代表股份数量277,882,179股，占公司有表决权股份总数的65.00%。其中，通过网络投票出席会议的股东22人，代表股份数量22,389,746股，占公司有表决权股份总数的5.24%。
出席会议的中小股东（除公司的董事、监事、高级管理人员及单独或者合计持有公司5%以上股份的股东以外的其他股东）共23人，代表股份27,646,755股，占公司有表决权股份总数的6.47%。
在独立董事征集投票权期间，共有0名股东委托独立董事投票，代表有表决权的股份量0股，占公司股份总数的0%。
公司董事、监事及见证律师出席了会议，公司高级管理人员列席了会议。

三、提案审议情况
本次股东大会采用现场记名投票和网络投票相结合的表决方式，表决结果如下：
1、逐项审议《关于<高升控股股份有限公司限制性股票激励计划（草案）>及其摘要的议案》；
1.01、《激励对象的确定依据和范围》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.02、《限制性股票的来源、数量和分配》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.03、《激励计划的有效期、授予日、锁定期、解锁期、禁售期》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.04、《限制性股票的授予价格及授予价格的确定方法》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.05、《限制性股票的授予与解锁条件》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.06、《激励计划的调整方法和程序》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.07、《限制性股票的会计处理》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.08、《激励计划的实施、授予及解锁程序》。
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.09、《公司/激励对象各自的权利义务》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.10、《公司/激励对象发生异动的处理》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
1.11、《限制性股票的回购注销原则》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
2、《关于<高升控股股份有限公司限制性股票激励计划实施考核管理办法>的议案》；
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
3、《关于提请股东大会授权董事会办理公司限制性股票激励计划有关事项的议案》。
总表决情况：同意277,882,179股，占出席会议有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
中小股东表决情况：同意27,646,755股，占出席会议的中小股东有效表决权股份总数的100%；反对0股；弃权0股。
表决结果：通过该议案。
截至本次股东大会股权登记日，关联股东张驰先生持有本公司有表决权股份数20,000股、罗向涛先生持有本公司有表决权股份数18,100股、常燕女士持有本公司有表决权股份数17,600股、张继红先生持有本公司有表决权股份数18,552股，对上述议案的表决予以回避。

四、律师见证意见
公司聘请的北京康达律师事务所律师出席了本次会议并发表如下法律意见：
高升控股公司本次股东大会的召集、召开程序符合《公司法》、《上市公司股东大会规则》等法律、行政法规、规范性文件以及《公司章程》的规定，出席会议人员及会议召集人的资格均合法有效，本次股东大会的表决程序、表决结果合法有效。

五、备查文件目录
（一）高升控股股份有限公司2015年第四次临时股东大会文件；
（二）北京康达律师事务所出具的法律意见书。
特此公告

高升控股股份有限公司
董事会
二〇一五年十二月二十四日

证券代码：002084　证券简称：海鸥卫浴　公告编号：2015-088

广州海鸥卫浴用品股份有限公司关于筹划非公开发行股票事项暨继续停牌的公告

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。

因公司正在筹划非公开发行股票事项，根据《深圳证券交易所股票上市规则》的有关规定，经向深圳证券交易所申请，公司股票（证券简称：海鸥卫浴