（上接B54版）

联系电话：15801816961
客服热线：4000676266
公司网址：www.leadfund.com.cn
（88）名称：广发银行股份有限公司
住所：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：董建岳
联系人：詹金鑫、张大奕
电话：020-38322222，0571-96000888
传真：020-87311780
客服电话：400-830-8003
公司网站：www.cgbchina.com.cn
（89）名称：北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层
法定代表人：董浩
联系人：于婷婷
电话：13811217674
客服电话：010-56409010
公司网址：www.jimufund.com
（90）名称：北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人：梁洪军
联系人：季长军
电话：13621233213
传真：010-68854009
客服电话：4008-196-665
公司网址：www.buyforyou.com.cn
（91）名称：上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服电话：4008219031
公司网址：www.lufunds.com
（92）名称：徽商期货有限责任公司
注册地址：合肥市芜湖路258号
办公地址：合肥市芜湖路258号
法定代表人：吴国华
联系人：蔡芳
联系电话：0551-62862801
业务传真：0551-62862801
客服热线：4008878707
公司网址：www.hsqh.net
（93）名称：中国邮政储蓄银行
注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
联系人：栗先生
电话：010-68857763
传真：010-68858859
客服电话：95580
公司网址：www.psbc.com
（94）名称：深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区高新技术产业园南七道惠佳集团二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人：马力佳
电话：0755-83999907-815
传真：0411-83999926
客服电话：0755-83999907
公司网址：www.jinqianwo.cn
（95）名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵中路668号
办公地址：江苏省常州市延陵中路668号
法人代表：王国军
联系人：续彭刚
联系电话：0519-89995001
客服电话：0519-96005
传真：0519-89995001
网址：www.jnbank.cc
（96）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
（97）名称：北京君德汇富投资咨询有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人：李振
联系人：魏尧
电话：010-65181028
传真：010-65174782
客服电话：400-066-9355
公司网址：www.kingstartimes.com
（98）名称：珠海盈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
（99）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
（100）名称：大连银行股份有限公司
注册地址：大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼
办公地址：大连市中山区中山路88号天安国际大厦9楼
法定代表人：陈占维
联系人：李鹏
电话：0411-82308602
传真：0411-82311420
客服电话：4006640099
公司网址：www.bankofdl.com
（101）名称：第一创业证券股份有限公司
通讯地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
传真：0755-23838750
联系人：毛诗莉
客服电话：4008881888
公司网站：www.fcsc.cn
（102）名称：开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：黄芳、袁伟涛
电话：029-63387256
传真：029-81887060
客服电话：400-860-8866
公司网址：www.kysec.cn
（103）名称：上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
传真：021-63332523
客服电话：4000 178 000
公司网址：www.lingxianfund.com
3、其他代销机构
本基金发售期间，若新增代销机构或代销机构新增营业网点，则另行公告。
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
二、注册登记人
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
法定代表人：王志伟
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
电话：020-89188970
传真：020-89899175
联系人：李尔华
三、出具法律意见书的律师事务所
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：黄贡、陈桂华
联系人：程秉
四、审计基金资产的会计师事务所
名称：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
联系人：洪锐明
电话：021-61418888
传真：021-63350003
经办注册会计师：郭新华、洪锐明

第四部分　基金的名称

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

第五部分　基金的类型

混合型发起式证券投资基金。

第六部分　基金的投资目标

本基金追求长期稳定的绝对收益。在有效控制系统性风险的基础上，通过量化模型构建市场中性投资组合，对冲市场系统风险，力争实现超越业绩比较基准的绝对收益。

第七部分　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（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（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债等）、权证、货币市场工具、股指期货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(但须符合中国证监会相关规定)。
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。

第八部分　基金的投资策略

一、投资策略
本基金主要采用对冲套利的投资策略，坚持模型驱动的纪律性，运用基金管理人自主研发的量化多因素选股模型，选取具备投资价值的股票构建投资组合，并做空股指期货进行对冲操作，有效的规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益，力争实现基金资产长期稳健的增值。
（一）股票投资策略
本基金采用量化选股的方法，利用基金管理人自主研发的量化多因素选股模型进行股票投资价值定量分析，并在此基础上构建股票投资组合。在实际管理运作中，基金管理人将紧密跟踪模型的有效性和市场环境，及时对模型进行定期或不定期的修正，以降低投资风险。
本基金采用的量化选股模型建立在海外市场上广泛应用的多因素量化选股模型框架的基础之上，针对国内A股市场的实际情况，通过对中国市场运作规律的长期研究以及对大量历史数据的统计分析和实证检验，开发出的更具备本土适应性和有效性的A股量化选股模型，该模型按照对股票超额收益的区分能力、解释强度和稳健度为目标，从多个维度构建定量分析指标，包括估值水平、成长能力、盈利能力、分析师预期、市场因素等五大类指标。
具体来讲，估值水平指标包含静态、动态的市盈率、市净率、市销率等；成长能力指标主要包括长期主营业务收入增长率、长期利润增长率等；盈利能力指标主要包括净资产收益率、主营业务利润率、资产净利率等；分析师预期指标主要考虑股票评级的变动情况以及盈利预测的变动情况等；市场因素指标主要包括技术面和动量反转类等指标。
（二）股指期货对冲策略
在通过以上的量化多因素模型进行选股、构建股票组合的基础上，本基金利用优化程序对个股的权重进行优化配置，以提高股票投资组合与股指期货的价格走势的相关性，然后通过卖空股指期货对冲组合的系统性风险，从而分离出组合的超额收益。
具体来讲，根据完全套保的原则，首先通过股票投资组合的市值计算卖空股指期货的数量；然后综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性以及保证金要求等各种因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。
本基金做空的股指期货合约价值与股票投资组合的市值相匹配，权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在90%—110%之间，从而基本上保持市场中性。
（三）事件驱动套利策略
事件驱动策略投资于发生特殊事件或转变时能带来超额收益的股票，例如发生高送转、定向增发、ETF指数基金定期调样等事件。通过定量分析，该类事件的发生会大概率引起证券价格的短期波动，通过买入事件驱动的股票，获得低风险下的投资收益。主要有以下几类：
1、指数成分调整套利策略
在指数每年两次的成份股调整期间，根据需要调入指数的股票相对于指数一般有更好的表现这一特征，在调整实施日前提前买入需要调入的股票，从而获得超额收益。
2、股指期货基差套利策略
利用股指期货与股票现货指数之间价差（通常称为基差）的运行规律，在期货价格高出指数现货价格一定范围时，买入现货指数成分股（或者ETF），并同时做空期货对冲，等基差收敛时再卖掉股票现货（或者ETF）、平掉期货实现收益。
3、可转债和股票利率策略
在可转换债券的转换期间内，由于未来股价涨跌具有不确定性，当可转换债券或股票交易波动较大时，可能出现可转换债券与正股之间存在套利机会的现象或者出现可转换债券流动性暂时不足的现象，采用可转换债券转股策略，即：将持有的可转换债券在转换期内转股抛售以获得套利收益，实现可转换债券投资收益最大化。
（四）其他投资策略
1、债券投资策略
在债券投资上，本基金将坚持稳健投资原则，对各类债券品种进行配置。本基金将通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较，发现和确认市场失衡，把握投资机会；在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下，为投资者获得稳定的收益。
2、中小企业私募债投资策略
本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。
3、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。
根据有关规定，本基金投资权证遵循下述投资比例限制：
1）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
2）本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的百分之三。
3）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。
若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。
二、投资决策依据和投资程序
（一）投资决策依据
1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2、宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。
（二）投资决策程序
1、投资决策委员会制定整体投资战略。
2、研究发展部根据自身或者其他研究机构的研究成果，构建股票备选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股决策支持；固定收益部债券研究小组提供债券研究支持。
3、基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略，根据投研联席会议的决议，结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析，拟订所辖基金的具体投资计划，包括：资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。
4、投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。
5、根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由中央交易部执行。
6、中央交易部按相关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理小组。
7、监察稽核部的绩效评估与风险管理小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险，定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

第九部分　业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：1年期银行定期存款税后收益率。
本产品定位为追求绝对收益回报的基金产品，因此采用上述业绩比较基准。
如果相关法律法规发生变化，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，经基金管理人与基金托管人协商，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，而无须召开基金份额持有人大会。

第十部分　风险收益特征

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低，相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

第十一部分　基金投资组合报告

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股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3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12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。
1、期末基金资产配置组合

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	438,522,483.24	22.42
	其中：股票	438,522,483.24	22.42
2	固定收益投资	34,099,373.80	1.74
	其中：债券	34,099,373.80	1.74
	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	785,962,533.94	40.19
	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	526,325,903.31	26.91
7	其他各项资产	170,872,280.12	8.74
8	合计	1,955,782,574.41	100.00

2、期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,099,021.16	0.06
B	采矿业	14,702,043.84	0.76
C	制造业	145,337,515.85	7.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,791,270.61	1.02
E	建筑业	16,609,025.14	0.86
F	批发和零售业	16,686,149.80	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	17,225,959.93	0.89
H	住宿和餐饮业	127,003.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,638,594.84	0.50
J	金融业	142,817,870.70	7.38
K	房地产业	24,676,066.99	1.28
L	租赁和商务服务业	7,023,614.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	16,205.20	0.00
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	21,657,943.97	1.12
S	综合	1,004,806.00	0.05
	合计	438,522,483.24	22.67

3、期末基金投资前十名股票

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	671,653	24,179,508.00	1.25
2	601818	光大银行	5,695,744	24,149,954.56	1.25
3	601788	光大证券	776,400	17,810,616.00	0.92
4	601668	中国建筑	1,923,300	12,193,722.00	0.63
5	600999	招商证券	540,733	11,733,906.10	0.61
6	600048	保利地产	1,091,028	11,608,537.92	0.60
7	601166	兴业银行	675,514	11,531,023.98	0.60
8	600015	华夏银行	921,100	11,182,154.00	0.58
9	601328	交通银行	1,705,900	10,985,996.00	0.57
10	600027	华电国际	1,575,314	10,712,135.20	0.55

4、期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,039,000.00	1.55
	其中：政策性金融债	30,039,000.00	1.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,060,373.80	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,099,373.80	1.76

5、期末债券投资前五名组合

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150215	15国开15	300,000	30,039,000.00	1.55
2	132004	15国盛EB	18,440	2,052,372.00	0.11
3	132005	15国资EB	17,470	2,008,001.80	0.10

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投资。
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投资。
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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1601	IC1601	-5.00	-7,399,000.00	85,120.00	-
IF1601	IF1601	-382.00	-420,902,880.00	8,913,183.21	-
公允价值变动总额合计					8,998,303.21
股指期货投资本期收益					-252,990,383.21
股指期货投资本期公允价值变动					8,998,303.21

（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。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本基金本报告期末未持有国债期货。
（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。
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在本报告期内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未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
1	存出保证金	91,615,502.61
2	应收证券清算款	78,115,822.97
3	应收股利	-
4	应收利息	1,140,954.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	170,872,280.12

（4）报告期未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。
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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12月31日。
（一）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)
2015.2.6-2015.12.31	13.00%	0.37%	1.87%	0.00%	11.13%	0.37%
自基金合同生效起至今	13.00%	0.37%	1.87%	0.00%	11.13%	0.37%

（二）本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图
广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年2月6日至2015年12月31日)

注：（1）本基金合同生效日期为2015年2月6日，至披露时点本基金成立未满一年。
（2）本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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、证券账户开户费用和银行账户维护费；
9、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
基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：
（1）基金管理人的基本管理费
本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1%÷当年天数
H为每日应计提的基金基本管理费
E为前一日的基金资产净值
基金基本管理费每日计算，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基本管理费划款指令，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，支付日顺延。
（2）基金管理人的附加管理费
1）基金管理人可在满足以下条件的前提下，提取附加管理费：
附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费；即每次提取评价日提取的附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者，管理人才能收取附加管理费。附加管理费按照下述公式计算并收取，提取评价日是每次基金封闭期的最后一个工作日。
2）附加管理费的计算方法和提取
在满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：
附加管理费=[P(a)-P(h)]*10%*S(a)
其中：
P(a)：提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值
P(h)：以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1 的孰高者，其中首次封闭期的P(h)为1
S(a)：提取评价日的基金份额=提取评价日基金总份额/提取评价日的折算因子
特定日期的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积
折算系数=基金折算日除权前基金份额净值/基金折算日除权后基金份额净值
附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。由基金管理人向基金托管人发送基金附加管理费划款指令，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取。若遇法定节假日、公休假等，支付日顺延。
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，支付日顺延。
上述“一、基金费用的种类中第3—9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
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和基金托管费等相关费率。
调低基金管理费率和基金托管费率等费率，无需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上公告。

十四、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《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》的内容进行了更新，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内容；
2. 在“第四部分　基金托管人”部分，根据基金托管人人员变动及业务经营情况对基金托管人信息进行了相应更新；
3. 在“第五部分　相关服务机构”部分，增加了相关的代销机构，对原有销售机构的资料进行更新，相关事宜均已公告；
4. 在“第七部分　基金合同的生效”部分，内容进行了更新。
5. 在“第九部分　基金的投资”部分，更新了截至2015年12月31日的基金投资组合报告。
6. 在“第十部分　基金的业绩”部分，更新了截至2015年12月31日的基金业绩。
7. 在“第十一部分　基金资产的估值”部分，对原有估值方法进行更新，相关事宜均已公告。
8. 根据最新公告，对“第二十二部分　其他应披露事项”内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一六年三月十八日

证券代码：000697　证券简称：炼石有色　公告编号：2016-011

陕西炼石有色资源股份有限公司关于公司控股股东股权质押变化情况的公告

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、误导性陈述或者重大遗漏。

2016年3月17日，陕西炼石有色资源股份有限公司（以下简称“公司”）接到控股股东张政先生通知，其将持有的公司部分股份分别办理了质押和解除质押手续，现将有关情况公告如下：

一、股东股份质押的基本情况

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	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
张政	控股股东	22,922,350	2016年3月15日	办理解除质押登记之日	开源证券股份有限公司	16.29%	置换前期质押股份
张政	控股股东	3,497,650	2016年3月15日	办理解除质押登记之日	开源证券股份有限公司	2.48%	置换前期质押股份
合计		26,420,000				18.77%	

控股股东张政先生将其持有的公司26,420,000股（占公司股份总数的4.72%）股份分两笔在开源证券股份有限公司办理了股票质押式回购交易业务，占其直接持有公司股份总数的18.77%(未包含其通过资产管理计划持有的2,893,927股公司股份)。初始交易日为2016年3月15日，购回交易日为2017年3月14日。股份质押期限自2016年3月15日起，至向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理解除质押登记之日止。

二、股东股份解除质押的基本情况

2013年8月27日，张政先生将其持有的公司40,000,000股（占公司股份总数 的7.15%）限售股份同东方证券股份有限公司进行股票质押式回购交易业务，用 于向东方证券股份有限公司融资。初始交易日为2013年8月27日，购回交易日为 2015年8月26日。股份质押期限自2013年8月27日起，至向中国证券登记结算有限 责任公司深圳分公司办理解除质押登记之日止。

2015年7月1日，张政先生将该笔质押股份中的12,000,000股股份解除了质押。

上述事项分别于2013 年8月29日及2015年7月3日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》和指定网站（www.cninfo.com.cn）进行了披露。

2016年3月16日，张政先生将该笔质押股份中的28,000,000股股份解除了质押。

三、股东股份累计质押的情况

截止本公告签发日，张政先生直接持有公司股份140,723,102股(未包含其通过资产管理计划持有的2,893,927股公司股份)，占公司股份总数的25.14%。其中：累计质押99,093,701股，占公司股份总数的17.71%，均为股票质押式回购交易业务。

四、控股股东质押的股份是否存在平仓风险

公司控股股东张政先生质押的股份目前不存在平仓风险。公司控股股东股权 变动如达到《中华人民共和国证券法》、《上市公司收购管理办法》等规定的相 关情形的，公司将严格遵守权益披露的相关规定，及时履行信息披露义务。

特此公告。

陕西炼石有色资源股份有限公司董事会
二〇一六年三月十七日

证券代码：601689　证券简称：拓普集团　公告编号：2016-008

宁波拓普集团股份有限公司股东减持股份计划公告

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：

● 股东减持的基本情况：宁波金仑股权投资合伙企业（有限合伙）（以下简称"宁波金仑"）持有公司股份40,584,960股，约占公司总股本的6.25%；

● 减持计划的主要内容：公司股东宁波金仑拟计划自本减持计划公告之日起3个交易日之后、在证券交易所集中竞价交易为本减持计划公告之日起15个交易日之后，开始减持公司股份。六个月内计划减持不超过32,450,000股，即不超过公司总股本的5%。其中三个月内通过证券交易所集中竞价交易减持股份的总数，不超过公司股份总数的百分之一。

宁波拓普集团股份有限公司（以下简称"公司"）于近日收到股东宁波金仑的《股份减持计划告知函》，现将有关事项公告如下：

一、股东的基本情况

（一）股东名称

宁波金仑股权投资合伙企业（有限合伙）

（二）股东持有股份的总数量、持股股份的具体来源

宁波金仑在首次公开发行前持有公司股份40,584,960股，约占公司现有总股本的6.25%。

（三）股东及其一致行动人过去十二个月内减持股份的情况

公司股东宁波金仑自公司上市之日（即2015年3月19日）起至本公告日，未减持过公司股份。

二、本次减持计划的主要内容

（一）本次拟减持的具体安排

1、本次拟股份来源、减持数量及比例：宁波金仑拟减持自公司首次公开发行前持的股份，减持数量不超过32,450,000股，即不超过公司总股本的5%（若此期间有送股、资本公积转增股本等股本变动事项，应对该数量进行相应处理）。其中三个月内通过证券交易所集中竞价交易减持股份的总数，不超过公司股份总数的百分之一。

2、减持期间：自本减持计划公告之日起3个交易日之后、在证券交易所集中竞价交易为本减持计划公告之日起15个交易日之后至2016年9月21日。

3、减持价格：根据当时的二级市场价格确定，且不低于公司最近一期的每股净资产。截止本公告日，公司最近一期的每股净资产是指公司2015年三季报每股净资产4.684元，即本次减持价格不低于4.684元。

4、减持方式：包括但不限于二级市场集中竞价交易、大宗交易、协议转让等上海证券交易所认可的合法方式。

5、本次减持完成后，宁波金仑将在遵守相关法律法规及承诺的前提下，根据自身资金需求继续减持所持有的公司股份。

（二）本次拟减持事项是否与相关股东此前已披露的意向、承诺一致

根据公司《首次公开发行股票招股说明书》，宁波金仑对股份减持的承诺如下：

自公司股票上市交易之日起12个月内，不转让或者委托他人管理本次发行前所持有的拓普集团股份，也不由拓普集团回购本企业持有的该等股份。承诺期限或法定锁定期限届满后，上述股份可以上市流通和转让。在锁定期满后12个月内，累计减持的股份总数将不超过目前持股数量的80%，剩余所持股份将于锁定期满后13至24个月内减持完毕；减持股份应符合相关法律法规及上海证券交易所规则要求，减持方式包括二级市场集中竞价交易等上海证券交易所认可的合法方式；减持股份的价格根据当时的二级市场价格确定，且不低于发行人最近一期的每股净资产。拟减持发行人股票的，将提前三个交易日通过发行人进行公告，并按照《公司法》、《证券法》、中国证监会及上海证券交易所相关规定办理。

截止本公告日，公司股东宁波金仑严格遵守了上述承诺，本次拟减持的事项和此前已披露的意向、承诺一致。

（三）拟减持的原因：企业自身资金需求。

三、相关风险提示

（一）宁波金仑不是公司控股股东、实际控制人，本次减持计划实施不会导致公司控股股东、实际控制人的变化。

（二）在本次减持计划实施期间，公司将督促宁波金仑严格遵守法律法规及规范性文件的规定，及时履行信息披露义务。

特此公告。

宁波拓普集团股份有限公司
2016年3月17日

证券代码：600589　证券简称：广东榕泰　公告编号：临2016-019
债券代码：122219　债券简称：12榕泰债

广东榕泰实业股份有限公司关于全资子公司北京森华易腾通信技术有限公司通过数据中心联盟“可信云”认证的公告

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。

近日，公司全资子公司北京森华易腾通信技术有限公司（"森华易腾"）的森华云 云主机通过数据中心联盟"可信云"认证（符合标准：YDB144-2014），具体内容为：

森华易腾的云主机在数据存储的持久性、数据可销毁性、数据可迁移性、数据知情权、服务可审查性、服务功能、服务可用性、服务资源调配能力、故障恢复能力、网络接入性能、服务计量准确性、服务变更终止条款、服务赔偿条款、用户约束条款、服务商免责条款等指标项均满足可信云服务认证要求。

一、　关于认证的概况

数据中心联盟（Data Center Alliance，简称DCA）成立于2014年1月16日，上级管理单位为中国通信标准化协会，业务指导单位为工业和信息化部。DCA按照实用化、公平性、效率和共享合作的原则，开展数据中心、云计算、大数据和移动互联网等方面的标准预研、推广和评估等工作。

"可信云"服务认证是由数据中心联盟组织、中国信息通信研究院(工信部电信研究院)测试评估的面向云计算服务的评估认证。"可信云"作为我国唯一针对云计算信任体系的权威认证体系，有着非常高的专业性以及认证标准。

据了解，本次共有72家云服务提供商的87个云服务参加了本批次（2016年2月）可信云咨询和参评，有22家云服务商的30个云服务进入评审阶段。最终，共有17个云服务商的23个云服务通过第五批IaaS类可信云服务认证。

二、对上市公司的影响

公司本次"可信云"认证的顺利通过，标志着公司在云主机服务领域取得的成果更上一个台阶，对公司拓展云计算服务市场和提升公司核心竞争力有着重大战略意义

三、重大风险提示

"可信云"认证通过后，公司每年都要参加数据中心联盟后续的常规年检。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

广东榕泰实业股份有限公司董事会
二〇一六年三月十八日

股票代码：600847　股票简称：万里股份　公告编号：2016-