



信息披露

2014年4月4日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B47

(上接B46版)

5. 中小企业私募债券投资策略
中小企业私募债券利率较高,信用风险较大,二级市场流动性较差。
中小企业私募债券收益率由票面收益率与信用利差叠加而成,信用风险表现在信用等级的变化上,信用利差主要受两方面影响,一是系统性信用风险,即该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线变化;二是非系统性信用风险,即该信用债本身的信用变化。

针对市场系统性信用风险,本基金主要通过调整中小企业私募债券类资产的配置比例,谋求超额收益。因为经济周期的复苏初期通常是中小企业私募债券表现的最阶段,而过热时期通常是中小企业私募债券表现的最阶段。本基金运用深入的宏观研究,力求前瞻性判断经济周期,在经济周期的复苏初期保持适当增配的中小企业私募债券配置比例,在经济周期的过热期保持适当降配的中小企业私募债券配置比例。

针对非市场系统性信用风险,本基金通过“基本信用分析系统”,分析发债主体的信用水平及增信措施情况,量化比较判断估值,确定个债,谋求超额收益。

针对流动性风险,本基金在控制信用风险的基础上,对中小企业私募债券投资,主要采取分散投资,控制个债持有比例,主要采取深入,持有到期策略;当前期发债企业的基本面情况出现恶化时,采取 尽早出售 first sale, best sale/策略,控制投资损失。

6. 可转债投资策略
本基金将根据组合风险控制措施,以理性地控制可转债总体投资仓位。在个债选择上,本基金将深入研究内在债券价值和票面溢价及无条件回售价格,保护条款的适用范围、期权价值、基础债券的质地和成长性、流动性、发现投资价值,并积极寻找各种套利机会,谋求在较高安全边际上获取超额收益。

7. 投资决策
8.1 决策流程

1. 遵循有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2. 跟踪经济、政策、宏观经济运行状况、货币政策和财政政策执行状况、货币市场利率证券市场行情状况。
3. 分析并独立客观、及时完成相应的研究报告,为投资决策提供依据。
4. 决策程序
1. 投资决策流程投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略,审核并批准基金投资组合的资产配置方案或重大投资决策。
2. 相关研究部门或岗位根据需求中央研究平台、基金信用分析系统等流程规定,进行分析,提出分析报告。
3. 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究部门提出的报告,并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定具体资产配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。
4. 交易部根据基金经理的指令,制定交易策略并执行交易。
5. 跟踪债券估值和基金资产净值并管理基金估值,依据基金估值政策和基金合同和相关管理制度的规定,风险管理部运用风险监测模型以及各市场风险监控指标,对市场风险敞口进行风险监控,对基金组合的风险进行评估,提交风险监控报告;风险控制委员会根据市场变化优化基金投资组合进行风险评估与监控。

9. 基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:一年期银行定期存款税后收益率+1.1%

上述“一年期银行定期存款收益率”是指当期闭市后的第1个工作日中国人民银行公布并执行的一年期 金融机构人民币存款基准利率。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、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,本基金可以在中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

10. 基金的风险控制
本基金为证券投资基金,其固有风险和预期收益低于股票基金、混合基金、高于货币市场基金。

11. 基金的投资组合情况
本基金的投资组合由股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、衍生品等构成,并可根据市场变化进行动态调整。本基金的投资组合由股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、衍生品等构成,并可根据市场变化进行动态调整。

本基金投资于中国境内依法发行、符合中国证监会规定的具有良好流动性的金融工具,包括但不限于股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、衍生品等。本基金投资于中国境内依法发行、符合中国证监会规定的具有良好流动性的金融工具,包括但不限于股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、衍生品等。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	425,738,655.60	48.45
	其中:债券	425,738,655.60	48.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	438,002,536.23	49.85
6	其他资产	14,912,016.04	1.70
	合计	878,653,207.87	100.00
2.报告期末按行业分类的股票投资组合			

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

- 重要提示
1. 本次会议无否决或修改议案的情况;
 2. 本次会议无新议案提交表决;
 3. 本次会议不涉及变更前次股东大会决议。

一、会议召开和出席情况

1. 会议召开时间:2014年4月3日下午2点;
2. 网络投票时间:通过深圳证券交易所交易系统投票的时间为2014年4月3日上午9:30-11:30,下午13:00-15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统(http://wtp.cninfo.com.cn)投票的时间为2014年4月2日15:00至2014年4月3日15:00期间的任意时间;

1. 现场会议召开地点:公司7楼会议室;
2. 会议召开方式:采用现场记名投票表决和网络投票表决相结合的方式;
3. 会议召集人:公司董事会。2014年3月14日和2014年3月31日,公司董事会在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《巨潮资讯网》分别刊登了《东北证券股份有限公司关于召开2013年度股东大会的通知》和《东北证券股份有限公司关于召开2013年度股东大会的提示性公告》;

5. 会议主持人:公司董事长陈正先生;
6. 本次会议的召开符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》的规定;
7. 会议出席情况:

参加现场会议及网络投票的股东及股东代理人合计78人,代表股份数532,176,569股,占公司股份总数的54.3824%。其中参加现场会议的股东及股东代理人3人,代表股份数527,895,541股,占公司股份总数的53.9449%;参加网络投票的股东及股东代理人共有75人,代表股份数4,281,028股,占公司股份总数的0.4375%。

二、提案审议情况

本次会议通过现场记名投票表决和网络投票表决相结合的方式审议并通过了以下议案:

1. 审议通过了《公司2013年度董事会工作报告》

赞成532,132,868股,占出席会议的股东所持有效表决权股数的99.9918%;
反对3,100股,占出席会议的股东所持有效表决权股数的0.0006%;
弃权40,601股(其中,因未投票默认弃权15,900股),占出席会议的股东所持有效表决权股数的0.0076%;

此次议案获得通过。

2. 审议通过了《公司2013年度监事会工作报告》

赞成532,132,868股,占出席会议的股东所持有效表决权股数的99.9918%;
反对3,100股,占出席会议的股东所持有效表决权股数的0.0006%;
弃权40,601股(其中,因未投票默认弃权15,900股),占出席会议的股东所持有效表决权股数的0.0076%;

此次议案获得通过。

3. 审议通过了《公司2013年度财务工作报告》

赞成532,132,868股,占出席会议的股东所持有效表决权股数的99.9918%;
反对3,100股,占出席会议的股东所持有效表决权股数的0.0006%;
弃权40,601股(其中,因未投票默认弃权15,900股),占出席会议的股东所持有效表决权股数的0.0076%;

此次议案获得通过。

证券代码:000506 证券简称:中润资源 公告编号:2014-05

中润资源投资股份有限公司2013年度业绩快报

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、2013年度主要财务数据及指标

项目	本报告期	上年同期	增减幅度(%)
营业收入(万元)	90,719.44	107,061.49	-15.26%
营业利润(万元)	6,036.17	55,193.65	-89.85%
利润总额(万元)	18,141.87	34,877.64	-47.98%
归属于上市公司股东的净利润(万元)	18,518.10	31,826.49	-41.82%
基本每股收益(元)	0.1993	0.3426	-41.82%
净资产收益率(%)	11.65%	23.43%	-11.78%

项目	本报告期末	本报告期初	增减幅度(%)
总资产(万元)	337,915.55	514,784.07	-34.36%
归属于上市公司股东的所有者权益(万元)	166,189.18	151,649.83	9.59%
归属于上市公司股东的每股净资产(元)	1.79	1.63	9.82%

二、经营业绩和财务状况情况说明
本期营业收入、利润总额、归属于上市公司股东的净利润、基本每股收益以及总资产金额较上年同期均下降30%以上,变动原因主要为本期经营合并范围发生变化所致。

三、其他说明
公司2013年度财务报告的编制工作仍在进行中,届时将通过指定媒体发布2013年年度报告,敬请投资者注意投资风险。

四、备查文件
经公司法定代表人李明均先生、财务总监石鹏先生签字盖章的比较式资产负债表和利润表。

中润资源投资股份有限公司 董事会
2014年4月4日

博时基金管理有限公司关于裕隆证券投资基金的基金经理变更的公告

公告送出日期:2014年4月4日

1. 公告基本信息

基金名称	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金
基金简称	博时亚洲票息收益债券(QDII)
基金代码	050030
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经营变更类型	兼有增聘和解聘基金经理
新任基金经理姓名	何凯
离任基金经理姓名	过钧

2. 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名 何凯

任职日期 2014年4月2日

证券从业年限 8

证券投资管理机构从业年限 8

过往从业经历

2006-2008 荷兰银行 伦敦交易员

2008-2011 中国投资有限公司 一级经理

2012-2013 南方基金管理有限公司 固定收益执行董事、基金经理

2012-至今 博时基金管理有限公司 曾任国际投资部副经理兼基金经理助理,现任固定收益总部国际投资副总监兼基金经理助理。担任基金经理。

是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施 否

是否已取得基金从业资格 是

取得的其他相关从业资格 无

国籍 中国

学历、学位 研究生硕士

是否已按规定在中国证券投资基金业协会注册 是

3. 离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名 过钧

离任原因 岗位调动

离任日期 2014年4月2日

转任本公司其他工作岗位的说明 是

是否已按规定在中国证券投资基金业协会办理变更手续 是

4. 其他需要提示的事项

本公司已对上述基金经理变更事项报中国证监会深圳监管局备案。特此公告。

博时基金管理有限公司 二〇一四年四月四日

报告期末,本基金未持有股票。

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

报告期末,本基金未持有股票。

4. 报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,851,000.00	1.46
其中:政策性金融债	9,851,000.00	1.46	
4	企业债券	137,548,655.60	20.42
5	企业短期融资券	278,339,000.00	41.32
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
合计		425,738,655.60	63.20

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041353059	13国债(国)01	400,000	39,740,000.00	5.90
2	041366013	13国债(南)02	300,000	29,817,000.00	4.43
3	122000	07东电债	200,510	19,948,739.90	2.96
4	041355033	13中债(国)01	200,000	19,896,000.00	2.95
5	041363015	13国开(农)01	200,000	19,888,000.00	2.95

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

报告期末,本基金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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

8. 报告期末本基金投资组合前十大重仓股情况

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10. 投资组合报告附注

9. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

10. 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

11. 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 15,768.04

2 应收证券清算款 1,539,266.72

3 应收股利 -

4 应收利息 13,356,981.28

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

合计 14,912,016.04

9. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

十、基金的投资组合

本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。基金的投资组合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。

1. 报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

本报告期末基金投资组合资产配置及其与同期业绩比较基准收益变动的比较