(上接B254版)

联系人:王珊珊

四、基金的名称

本基金名称:工银瑞信货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型:货币市场基金

六、基金的投资目标

力求在保持基金资产本金稳妥和良好流动性的前提下,获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于以下金融工具,包括:

(1)现金;

(2)通知存款;

(3)1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;

(4)剩余期限在397天以内(含397天)的债券;

(5)期限在1年以内(含1年)的债券回购;

(6)期限在1年以内(含1年)的中央银行票据;

(7)中国证监会、中国人民银行认可并允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。

八、基金的投资策略

1、投资决策程序

本基金管理人实行"投资决策委员会领导下的团队制"管理模式,建立了严谨、科学的投资管理流程,具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程,如图1所示。

图1 工银瑞信固定收益证券投资管理流程

1)投资研究及投资策略制定

本基金管理人在固定收益证券投资与研究方面,借鉴瑞士信贷银行股份有限公司资产管理公司的经验,实行投资策略研究专业化分工制度,由基金经理与研究员组成专业小组,进行宏观经济及政策、产业结构、金融市场、单个证券等领域的深入研究,分别从利率、债券信用风险、相对价值等角度,提出独立的投资策略建议,经固定收益投资团队讨论,并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。该投资策略是公司未来一段时间内对该领域的风险和收益的判断,对公司旗下管理的所有基金或组合的固定收益类证券投资具有指导作用。

各个专业领域的投资策略专业小组每季度定期举行策略分析研讨会议,提出下一阶段投资策略,每周定期举行策略评估会议,回顾本周的各项经济数据和重大事项,分析其对季度投资策略的影响,检讨投资策略的有效性,必要的时候进行调整。

2)投资决策

基金经理在公司固定收益证券总体投资策略的指导下,根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定,制定相应的投资计划,报投资决策委员会审批。

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,决定基金总体投资策略及资产配置方案,审核基金经理提交的投资计划,提供指导性意见,并审核其他涉及基金投资管理的重大问题。

3)投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的决议,在权限范围内,评估债券的投资价值,选择证券构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合的日常管理。

4)交易执行

交易员负责在合法合规的前提下,执行基金经理的投资指令。

5)风险管理及绩效评估

风险分析专业人员对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估,报风险管理委员会,抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理,并就基金的投资组合提出风险管理建议。

法律合规部对基金的投资行为进行合规性监控,并对投资过程中存在的风险隐患向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

2、投资策略

1)利率策略

利率策略小组从组合久期及组合期限结构两个方向提出针对市场利率因素的投资策略。该小组全面研究GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。

利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略,例如:子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

2)信用策略

信用策略小组根据国民经济运行周期阶段,分析企业债券发行人所处行业发展前景,发行人业务发展状况,企业市场地位,财务状况,管理水平,债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定企业债券的信用风险利差。

3)类属配置策略

研究国民经济运行状况,货币市场及资本市场资金供求关系,以及不同时期市场投资热点,分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

4)相对价值策略

本基金认为市场普遍存在着失效的现象,短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多,投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同,发掘存在于这些不同因素之间的相对价值,也是本基金发现投资机会的重要方面。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动,通过深入分析市场参与者的立场和观点,充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素导致的市场失衡机会,形成相对价值投资策略,运用回购、远期交易合同等交易工具进行不同期限、不同品种或不同市场之间的套利交易,为本基金的投资带来增加价值。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为税后6个月银行定期储蓄存款利率,即(1-利息税率)×6个月银行定期储蓄存款利率。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

本报告期为2014年10月1日起至12月31日止。

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	固定收益投资	36,883,573,458.43	29.82
	其中:债券	36,883,573,458.43	29.82
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	14,490,756,636.22	11.72
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	70,220,870,615.44	56.78
4	其他资产	2,073,904,044.97	1.68
5	合计	123,669,104,755.06	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.46	
	其中:买断式回购融资	0.01	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	299,999,430.00	0.24
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

3、期末基金组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况:

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	140
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	164
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	140

注:本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

(2)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例:

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	15.78	0.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	1.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	36.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	26.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.66	0.24

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	7,392,737,884.27	6.00
	其中:政策性金融债	6,402,749,841.13	5.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	28,082,717,935.99	22.79
6	中期票据	1,408,117,638.17	1.14
7	其他	-	-
8	合计	36,883,573,458.43	29.93
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	13,200,000	1,319,065,581.15	1.07
2	140437	14农发37	9,200,000	919,391,568.56	0.75
3	140444	14农发44	8,800,000	882,771,896.08	0.72
4	140223	14国开23	6,700,000	671,887,123.63	0.55
5	140429	14农发29	4,900,000	490,102,789.07	0.40
6	140357	14进出57	4,800,000	480,790,783.46	0.39
7	1082183	10首钢MTN2	4,500,000	447,776,551.17	0.36
8	011437006	14中建材SCP006	4,100,000	411,365,465.16	0.33
9	041458049	14中铝业CP003	4,000,000	399,990,420.53	0.32
10	011410008	14中电投SCP008	3,500,000	349,874,036.19	0.28

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

6、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1547%
报告期内偏离度的最低值	-0.0385%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0842%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注

(1)基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

(2)本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值20%。

(3)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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(4)其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	983,106,762.82
4	应收申购款	1,090,462,582.15
5	其他应收款	334,700.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,073,904,044.97

十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、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,也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1.本基金合同生效日为2006年3月20日,基金合同生效以来(截至2014年12月31日)的投资业绩及同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值收益率(1)	净值收益率标准差(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)
2006.3.20-2006.12.31	1.3999%	0.0024%	1.3554%	0.0002%	0.0445%	0.0022%
2007年	3.5366%	0.0090%	2.4441%	0.0017%	1.0925%	0.0073%
2008年	4.1048%	0.0128%	3.4340%	0.0011%	0.6708%	0.0117%
2009年	1.2863%	0.0054%	1.9800%	0.0000%	-0.6937%	0.0054%
2010年	1.8057%	0.0032%	2.0289%	0.0003%	-0.2232%	0.0029%
2011年	3.3022%	0.0035%	3.0748%	0.0007%	0.2274%	0.0028%
2012年	4.0542%	0.0045%	3.0447%	0.0007%	1.0095%	0.0038%
2013年	4.3816%	0.0020%	2.8000%	0.0000%	1.5816%	0.0020%
2014.1.1-2014-12.31	4.8672%	0.0025%	2.7726%	0.0002%	2.0946%	0.0023%
自基金合同生效起至今	32.6043%	0.0069%	22.9345%	0.0017%	9.6698%	0.0052%

2.自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2006年3月20日至2014年12月31日)

注:1、本基金基金合同于2006年3月20日生效。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期。截至报告期末本基金的各项投资符合基金合同第十三条(三)投资范围、(八)投资组合限制与禁止行为中规定的各项要求:本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过180天;本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;除发生巨额赎回的情形外,本基金的投资组合中,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;法律法规及本基金合同规定的其他投资比例限制。

十三、费用概览

(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、销售服务费;

4、基金的证券交易费用;

5、基金合同生效以后的信息披露费用;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金合同生效以后的会计师费和律师费;

8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.33%÷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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、销售服务费

基金销售人的销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售费

E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给基金销售机构。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

4、本条第(一)款第4至第7项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

(四)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人调整上述费用时,必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

(五)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,更新内容如下:

1、在"三、基金管理人"部分,根据相关公告,更新了基金管理人主要人员情况等信息;

2、在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关信息;

3、在"五、相关服务机构"部分,更新了代销机构的相关信息;

4、在"八、基金的投资"部分,更新了投资组合报告;

5、在"九、基金的业绩"部分,更新了截至2014年12月31日的投资业绩;

6、在"二十、对基金份额持有人的服务"部分,更新了关于对账单服务和电子化交易的相关内容;

7、在"二十一、其他应披露的事项"部分,对本次更新内容期间的重要公告进行了更新。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,投资人欲查询本更新招募说明书正文,可登陆工银瑞信基金管理有限公司网站www.icbccs.com.cn。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一五年四月三十日

(上接B253版)

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	809,532,104.21	91.87
	其中:股票	809,532,104.21	91.87
2	固定收益投资	50,059,000.00	5.68
	其中:债券	50,059,000.00	5.68
	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	-	-
	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	17,684,838.73	2.01
7	其他资产	3,907,658.91	0.44
8	合计	881,183,601.85	100.00

2. 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	394,561,445.11	45.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	84,820,000.00	9.72
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	14,580,000.00	1.67
J	金融业	81,884,770.30	9.38
K	房地产业	167,175,344.30	19.15
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	66,510,544.50	7.62
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	809,532,104.21	92.75

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	000651	格力电器	1,800,000	66,816,000.00	7.65
2	600048	保利地产	4,999,936	54,099,307.52	6.20
3	002285	世联行	3,585,683	53,928,672.32	6.18
4	002415	海康威视	2,200,000	49,214,000.00	5.64
5	002572	索菲亚	2,000,000	42,800,000.00	4.90
6	002508	老板电器	1,300,000	42,380,000.00	4.86
7	300070	碧水源	1,200,000	41,760,000.00	4.78
8	002303	美盈森	2,990,000	40,125,800.00	4.60
9	601318	中国平安	499,930	37,349,770.30	4.28
10	002081	金螳螂	2,000,000	33,600,000.00	3.85

4. 报告期末按债券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	50,059,000.00	5.74
	其中:政策性金融债	50,059,000.00	5.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	50,059,000.00	5.74

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	140212	14国开12	400,000	40,052,000.00	4.59
2	140218	14国开18	100,000	10,007,000.00	1.15

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。

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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。

时点选择:基金管理人在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

套保比例:基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

合约选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1

1、中国平安保险(集团)股份有限公司(下称"中国平安",股票代码:601318)控股子公司平安证券因其推荐海联讯IPO的过程中,出具的保荐书存在虚假记载以及未审慎审查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性,于2014年12月8日收到《中国证监会行政处罚决定书》。该处罚决定书对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款。

本基金投研人员认为:中国平安子公司平安证券受到行政处罚,体现出其原有业务流程存在一定的瑕疵。但是经过内部整改,我们预计其流程管理已经有所完善。而且中国平安作为综合金融的上市公司,其子公司平安证券只是其中一个业务板块,对整个上市公司的经营影响有限,并不影响对中国平安具备投资价值的判断。

本基金经理依据基金合同及公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对中国平安进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	706,694.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,376,596.73
5	应收申购款	1,824,367.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,907,658.91

11.4 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。

11.5 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的情况。

第十二部分、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,投资者在作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2014年12月31日。

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2014年3月19日至2014年12月31日	28.20%	0.98%	52.12%	0.97%	-23.92%	0.01%

2、自基金合同生效以来基金份额累计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

注:本基金的投资组合比例为:本基金将基金资产的60%-95%投资于股票资产,其中,投资于具备竞争优势的公司股票的资产不低于非现金基金资产的80%,权证投资比例不超过基金资产净值的3%,将基金资产的5%-40%投资于债券等固定收益类品种,其中,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,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2014年3月19日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日(2014年3月19日)起至本报告期末不满一年。

第十三部分、基金费用概览

一、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、期货交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、证券、期货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。

(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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷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,由基金托管人与基金管理人核对后于次月第2-5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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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,由基金托管人与基金管理人核对后于次月第2-5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。

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。

二、与基金销售有关的费用

1、基金认购费用

(1)投资者认购需全额缴纳认购费用。认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。认购费率表如下:

认购金额(M)	认购费率
M<50万	1.2%
50万≤M<100万	0.8%
100万≤M<500万	0.2%
M≥500万	按笔收取,1000元/笔

(2)计算公式

当认购费用适用比例费率时:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额发售面值。

当认购费用适用固定金额时:

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购期间利息)/基金份额发售面值

认购费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留到小数点后两位;认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

2、基金申购费用

(1)本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担,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。

本基金的申购费率不高于1.5%,随申购金额的增加而递减,适用以下前端收费费率标准:

申购金额(M)	申购费率
M<50万	1.5%
50万≤M<100万	1.0%
100万≤M<500万	0.3%
M≥500万	按笔收取,1000元/笔

(2)计算公式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

当申购费用适用比例费率时:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

当申购费用适用固定金额时:

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份数=净申购金额/T日基金份额净值

3、基金赎回费用

(1)本基金的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。对持续持有期少于7日的投资人收取1.5%的赎回费,对持续持有期少于30日的投资人收取0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于6个月的投资人,将赎回费总额的25%归入基金财产。其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率随持有期限的增加而递减。

持有期	赎回费率
7日以内	1.5%
7日以上(含)-30日以内	0.75%
30日以上(含)--1年以内	0.5%
1年以上(含)-2年	0.25%
2年以上(含)	0

注:就赎回费而言,1年指365天,2年指730天。

(2)计算公式

本基金的赎回采用"份额赎回"方式,赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算,基金的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用,其中:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

4、基金转换费用

(1)本基金的转换费用由赎回费用和申购补差费组成,转出时收取赎回费,转入时收取申购补差费。其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定,申购补差费的收取标准为:申购补差费=MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用-转出净额在转出基金中对应的申购费用,0】。

(2)计算公式

①基金转出时赎回费的计算:

由股票基金转出时:

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时:

转出总额=转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益(全额转出时)

赎回费用=转出总额×转出基金赎回费率

转出净额=转出总额-赎回费用

②基金转入时申购补差费的计算:

净转入金额=转出净额-申购补差费

其中,申购补差费=MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用-转出净额在转出基金中对应的申购费用,0】

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

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、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。

第十四部分、对招募说明书更新部分的说明

1、在"第三部分、基金管理人"部分,更新了基金管理人高级管理人员、基金经理及投资决策委员会委员的相关信息;

2、在"第四部分、基金托管人"部分,更新了托管人相关情况信息;

3、在"第五部分、相关服务机构"部分,更新了基金份额销售机构的相关信息;

4、在"第八部分、基金份额的申购、赎回、转换及其他登记业务"部分,更新了基金首次申购及账户最低持有份额限额以及基金定期定额投资计划相关的信息;

5、在"第十二部分、基金投资组合报告"部分,更新了基金的投资组合报告,数据截至2014年12月31日;

6、更新了"第十三部分、基金的业绩"部分,数据截至2014年12月31日;

7、更新了"第十六部分、基金的费用与税收",更新了与基金销售有关的费用的信息;

8、在"第二十三部分、对基金份额持有人的服务"部分,更新了对基金份额持有人服务的相关信息。

9、在"第二十四部分、其它应披露事项"部分,更新了近期发布的与本基金有关的公告目录,目录更新至2015年3月19日。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一五年四月三十日

证券代码:002037 证券简称:久联发展 公告编号:2015-33

贵州久联民爆器材发展股份有限公司股票交易异常波动公告

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。

一、股票交易异常波动情况

贵州久联民爆器材发展股份有限公司(以下简称"公司")于2015年2月3日在巨潮资讯网、《中国证券报》、《证券时报》刊载了《重大事项停牌公告》;于2015年4月28日在巨潮资讯网、《中国证券报》、《证券时报》刊载了公司《2014年年度报告及其摘要》、《2015年第一季度报告及其摘要》、《关于公司控股股东保利久联集团拟与盘化集团资产整合的公告》、《关于公司非公开发行股票预案》等相关文件。公司股票(证券简称:"久联发展",证券代码:002037)自2015年4月28日开市起复牌。在复牌后的2015年4月28日、4月29日连续两个交易日内日收盘价涨幅偏离值累计超过20%,属于《深圳证券交易所交易规则》规定的股票交易异常波动。

二、关注、核实的情况说明

针对公司股票交易异常波动,公司对有关事项进行了核查,有关情况说明如下:

1、公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处;

2、未发现近期公共传媒报道了可能或已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息;

3、近期公司经营情况及内外部经营环境没有或预计将要发生重大变化;

4、除公司在2015年4月28日已经披露的公司2014年年度报告、2015年第一季度报告、公司拟非公开发行股票、控股股东保利久联集团拟与盘化集团资产整合等事项外,公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的其他重大事项;

5、控股股东及实际控制人在交易异常波动期间未买卖公司股票;

6、截止目前公司2014年度分红方案已经公司四届二十八次董事会审议通过,需经公司股东大会审批实施;

7、经自查,公司不存在违反公平信息披露的情形。

8、在关注、核实过程中,未发现涉及其他应披露事项。

三、不存在应披露而未披露信息的说明

本公司董事会确认,公司截止目前没有任何根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等,董事会也未获悉本公司有根据《股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的、对本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的信息。

四、风险提示

(一)控股股东保利久联集团拟与盘化集团资产整合的风险提示

1、交易终止风险:由于本次资产整合事项仍然处于磋商阶段,存在交易各方诉求差异较大进而导致交易终止的风险。

2、审批风险:本次资产整合各方如果能够签署整合协议,尚需履行的审批程序包括但不限于各方控股股东的审批、评估报告的相关国资委审批、交易事项的相关国资委审批、商务部的经营者集中审查等程序,上述审批或审查均为本次交易完成的前提条件,本次交易能否取得上述批准或核准以及最终取得批准和核准的时间均存在不确定性。

3、未来注入上市公司审批风险:未来保利久联集团将盘化集团资产注入上市公司仍需要履行包括但不限于各方董事会审批、股东大会批准、评估报告的相关国资委审批、交易事项的相关国资委审批等程序,存在审批周期过长甚至交易终止的风险。

(二)公司非公开发行股票的风险提示

1、市场风险:公司主营业务包括民爆产品生产及爆破工程技术服务,该等民爆产品需求及爆破工程业务拓展与国家及西部地区经济发展密切相关,具有较强的经济周期性特点。如果国家及西部地区基础设施建设及矿产资源投资放缓,公司民爆产品需求及爆破工程业务拓展将面临一定的市场风险。

2、安全风险:民爆器材生产及爆破工程服务涉及研发、生产、销售、储运、使用及爆破工程服务等诸多环节,由于民爆产品的特殊属性,存在因偶发因素发生安全事故风险,从而对公司生产经营构成影响。

3、管理风险:本次发行完成后,公司资产规模将进一步扩张,爆破一体化服务业务规模大幅增加,对公司民爆产品研发生产、爆破一体化服务管理能力均提出了更高要求。若公司生产及工程管理、销售管理、质量控制、风险控制等能力不能适应资产及各项业务规模的迅速扩张,人力资源储备、组织架构和管理制度不能进一步健全完善,将会引发相应的管理风险。

4、财务风险:本次发行完成后,公司总股本及净资产规模将较大幅度增加,将摊薄公司每股收益及净资产收益率。

5、股票价格波动风险:本次非公开发行股票将对公司的生产经营和财务状况发生较大影响,公司基本面情况的变化将会影响股票价格。另外,国家宏观经济形势、重大政策、国内外政治形势、股票市场的供求变化以及投资者的心理预期都会影响股票的价格,给投资者带来风险。中国证券市场尚处于发展阶段,市场风险较大,股票价格波动幅度比较大,有可能会背离公司价值。

6、本次非公开发行的审批风险:本次非公开发行尚需满足多项条件方可完成,包括但不限于国务院国资委的批准、公司股东大会审议通过本次非公开发行方案和中国证监会对本次非公开发行的核准等。上述事项能否获得相关的批准或核准,以及公司就上述事项取得相关的批准和核准时间也存在不确定性。

本公司郑重提醒广大投资者,《中国证券报》和《证券时报》为本公司指定信息披露的报刊,巨潮资讯网站(www.cninfo.com.cn)为本公司指定信息披露网站。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

贵州久联民爆器材发展股份有限公司董事会

2015年4月29日

证券代码:603729 证券简称:龙韵股份 公告编号:临2015--005

上海龙韵广告传播股份有限公司第三届董事会第四次决议公告

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、董事会会议召开情况

上海龙韵广告传播股份有限公司(以下简称"公司")第三届董事会第四次会议通知于2015年4月18日以专人送达方式发出,会议于2015年4月29日9:00-11:00在上海龙韵广告传播股份有限公司(上海浦东东方路18号保利广场e座17层)一号会议室召开。应到董事5人,实到董事5人。公司监事、高管人员列席了本次会议。本次会议的召集、召开以及参与表决董事人数符合《公司法》、《公司章程》等有关法律、法规的规定。

二、董事会会议审议情况

会议由董事长段佩璋先生主持,经参加会议董事认真审议并经记名投票方式表决,审议通过以下议案:

(一)审议通过《2014年度总经理工作报告》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二)审议通过《2014年度董事会工作报告》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(三)审议通过《2014年度独立董事述职报告》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(四)审议通过《2014年度董事会审计委员会履职报告》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(五)审议通过《关于公司2014年年度财务报告的议案》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(六)审议通过《公司2014年度财务决算报告》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(七)审议通过《关于公司2014年度利润分配方案的议案》。

根据中准会计师事务所有限公司对本公司2014年度财务报告进行审计,并根据中准审字[2015]1554《审计报告》,2014年度实现利润总额95,603,361.95元,实现归属于上市公司股东的净利润78,341,668.85元,母公司实现净利润7,152,131.5元。

根据《公司法》和《公司章程》等相关规定,以母公司报表中可供分配利润为依据,在提取10%法定盈余公积26,150,139.65元后,2014年末母公司累计可供股东分配利润393,919,444.34元。公司2014年度利润分配预案为:以公司总股本6,667万股为基数,按每10股派发现金股利人民币1.3元(含税),不送红股,不以公积金转增股本,共计派发人民币8,667,100元。

独立董事事前认可意见:作为公司独立董事,我们根据相关规定和公司提供的会议文件,同意将以上提案报告提交公司三届四次董事会会议审议。

独立董事独立意见:公司响应证监会、上交所关于积极回报投资者的号召,坚持现金分红,拟定的2014年度利润分配方案符合公司章程和中国证监会《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》(证监发[2012]37号)的要求,我们对董事会提出的公司2014年度利润分配预案无异议。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(八)审议通过《关于聘请公司2015年度会计师事务所及确认2015年审计费用的议案》

董事会拟继续聘任中准会计师事务所(特殊普通合伙)为公司内部控制审计和财报审计机构。为便于工作开展,建议董事会提请股东大会确定2015年度的审计费用:公司2015年审计费用50万元。

独立董事事前认可意见:作为公司独立董事,我们根据相关规定和公司提供的会议文件,同意将以上提案报告提交公司三届四次董事会会议审议。

独立董事独立意见:

中准会计师事务所自担任公司外部审机构以来,始终坚持原则,尽职尽责,维护公司和投资者的根本利益。我们同意公司2015年继续聘请中准会计师事务所担任公司外部审机构。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(九)审议通过《2015年第一季度报告》

《2015年第一季度报告》具体内容详见2015年4月30日上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十)审议通过《关于修改公司注册资本及<公司章程>部分内容的议案》

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十一)审议通过公司《关于注销龙韵股份合肥分公司的议案》

出于公司业务发展需要,拟注销合肥分公司。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十二)审议通过《关于在西藏设立全资子公司的议案》

出于公司业务发展需要,拟在西藏设立全资子公司,注册资本2000万。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十三)审议通过《关于在西藏设立控股子公司的议案》

出于公司业务发展需要,拟在西藏设立控股子公司,注册资本2000万,公司持有51%股权。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十四)审议通过《关于为全资子公司新疆逸海电广传媒文化发展有限公司提供银票授信担保的议案》

公司拟为全资子公司新疆逸海电广文化发展有限公司(以下简称"新疆逸海")向上海浦东发展银行股份有限公司乌鲁木齐分行提供最高不超过3000万元,期限为一年的授信担保。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十五)审议通过《关于修订<董事会议事规则>议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十六)审议通过《关于修订<股东大会议事规则>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十七)审议通过公司《关于修订<募集资金管理办法>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十八)审议通过《关于修订<关联交易制度>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(十九)审议通过《关于修订<公司信息披露制度>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二十)审议通过《关于修订<对外担保制度>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二十一)审议通过《关于修订<审计委员会工作制度>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二十二)审议通过《关于修订<内部审计制度>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二十三)审议通过《关于修订<董事会秘书工作制度>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二十四)审议通过《关于修订<公司股东大会网络投票实施细则>的议案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

(二十五)审议通过《关于提请召开2014年年度股东大会的提案》。

表决结果:赞成:5票,反对:0票,弃权:0票

上述第二、三、六、七、八、十、十一、十五、十六、十七、十八、二十三、二十四项议案需提交公司股东大会审议批准。

特此公告。

上海龙韵广告传播股份有限公司

董事会

2015年4月30日