中信建投稳利保本混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2015年第【1】号

基金管理人:中信建投基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司

重要提示

中信建投稳利保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）募集的准予注册文件名称为:《关于准予中信建投稳利保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2014〕914号），注册日期为:2014年9月3日。本基金合同于2014年9月26日正式生效。

基金管理人保证本《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，自主判断基金的投资价值，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金投资策略所特有的风险、担保风险、本基金到期期间操作所特有的风险、投资股指期货的风险和未知价风险和其他风险等。如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，转型为“中信建投稳利混合型证券投资基金”后将投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

本基金为保本混合型基金，属证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金。投资者投资于保本基金并不等将基金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在损失投资本金的风险。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2015年3月26日，有关财务数据和净值截止日为2014年12月31日（财务数据未经审计）。本基金托管人北京银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:中信建投基金管理有限公司

住所:北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

办公地址:北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心E座2层

邮政编码:100010

法定代表人:蒋月勤

成立日期:2013年9月9日

批准设立机关:中国证监会

批准设立文号:证监许可〔2013〕1108号

经营范围:基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

组织形式:有限责任公司

注册资本:15000万元

联系人:杨露露

电话:010-59100288

存续期间:永久存续

股权结构:中信建投证券股份有限公司占55%、航天科技财务有限责任公司占25%、江苏广传广播传媒有限公司占20%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

蒋月勤先生，成都电子科技大学硕士研究生学历。曾任职中信证券自营部首席交易员、长盛基金管理有限公司总经理，现任中信建投证券股份有限公司党委委员、经营决策会成员、董事总经理，兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

袁野先生，德国特里尔大学硕士研究生学历。曾任德国HVB银行卢森堡分行产品经理、中信建投证券股份有限公司机构业务部高级经理、资产管理部总监，现任中信建投基金管理有限公司总经理。

邹迎光先生，中央财经大学金融学硕士，中欧国际工商学院EMBA。曾任华夏证券海淀南路营业部机构部经理、华夏证券债券业务部高级业务董事、中信建投证券债券业务部总经理助理。现任中信建投证券经营决策会成员、董事总经理、固定收益部行政负责人。

石明磊先生，哈尔滨工业大学硕士研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司总经理助理，现任航天科技财务有限责任公司副总经理。

安冉女士，南京大学商学院硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台财务资产部副主任，现任江苏省广播电视总台财务资产部主任。

杜宝成先生，北京大学法律系硕士研究生学历。曾任北京市律师协会职员，中国侨联华联律师事务所律师，现任北京市融商律师事务所高级合伙人、律师。

王汀汀先生，北京大学博士研究生学历。现任中央财经大学副教授。

王宏利女士，北京师范大学硕士研究生学历。曾任北京瑞达会计师事务所部门副经理，北京中洲光华会计师事务所高级经理，天健正信会计师事务所合伙人兼事务所人力资源委员会委员兼北京所管理委员会委员，现任大华会计师事务所合伙人兼事务所人力资源和薪酬考核委员会委员。

陈冬华先生，上海财经大学博士研究生学历，香港科技大学博士后，历任上海财经大学会计学院助教、副教授、教授，现任南京大学商学院会计学系教授、博士生导师、会计与财务研究院副院长。

2、监事会成员

孔萍女士，中国人民大学金融专业研究生，曾任中国工商银行财务处副科长，华夏证券财务、稽核、清算部部门总经理，现任中信建投证券股份有限公司运营管理部总经理。

许会芳女士，中国人民银行研究生部金融学硕士研究生，现任航天科技财务有限责任公司风险与法律部总经理。

周琰女士，南京大学硕士研究生，现任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科副科长。

张金先生，中国人民银行研究生部金融学硕士。曾就职于中信建投证券股份有限公司债券承销部、债券销售交易部、资本市场部企业债券发行岗，现任中信建投基金管理有限公司特定资产管理部总经理。

陈晨先生，北京工业大学学士。曾就职于华夏证券股份有限公司信息技术部网络管理岗、中信建投证券股份有限公司信息技术部网络管理岗，现任中信建投基金管理有限公司信息技术部总监。

任巧二女士，对外经济贸易大学金融学硕士。曾任中信基金市场部产品经理、华夏基金机构产品部产品经理、中信建投基金管理有限公司基金市场部产品总监，现任中信建投基金管理有限公司产品与金融工程部总监。

3、高级管理人员

蒋月勤先生，现任公司董事长，简历同上。

袁野先生，现任公司总经理，简历同上。

周建萍女士，北京大学在职研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司投资部总经理、资产管理部总经理、交易部总经理，现任中信建投基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

王浩先生，中央财经大学证券投资专业硕士，曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

5、投资决策委员会成员

袁野先生，简历同上。

王琦先生，中国人民大学金融专业博士。曾任大通证券研发中心研究员，中关村证券研发中心研究员，中信建投证券交易部总监。现任中信建投基金管理有限公司投资研究部总经理。

周户先生，南开大学硕士研究生，曾任渤海证券研究员、广发证券研究员、国金证券及其下属基金公司研究员，现任中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

名称:北京银行股份有限公司(简称:北京银行)

住所:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:闫冰竹

成立时间:1996年01月29日

组织形式:股份有限公司（上市）

注册资本:人民币88亿元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2008]776号

联系人:赵姝

联系电话:(010) 6622 3695

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;从事同业拆借;提供担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱业务;办理地方财政信用周转使用资金的委托贷款业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;同业外汇拆借;国际结算;结汇、售汇;外汇票据的承兑和贴现;外汇担保;资信调查、咨询、见证业务;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券;自营和代客外汇买卖;证券结算业务;开放式证券投资基金代销业务;债券结算代理业务;短期融资券主承销业务;经中国银行业监督管理委员会批准的其它业务。

发展概况:

北京银行成立于1996年，是一家中外资本融合的新型股份制银行。成立18年来，北京银行依托中国经济腾飞崛起的大好形势，先后实现引资、上市、跨区域、综合化等战略突破。目前，已在北京、天津、上海、西安、深圳、杭州、长沙、南京、济南及南昌等10大中心城市设立300多家分支机构，发起设立北京延庆、浙江文成及吉林农安北银村镇银行，成立香港和荷兰阿姆斯特丹代表处，发起设立国内首家消费金融公司——北银消费金融公司，首批试点合资设立中荷人寿保险公司，先后设立中加基金管理公司、北银金融租赁公司，开辟和探索了中小银行创新发展的经典模式。

截至2014年9月末，北京银行资产达到1.49万亿元，实现净利润126亿元，成本收入比仅23.49%。ROA1.19%，ROE19.76%，不良贷款率0.76%，拨备覆盖率为336.57%，资本充足率10.19%，品牌价值201.36亿元，一级资本排名全球千家大银行99位，首次跻身全球银行业百强，各项经营指标均达到国际银行业先进水平，打造了人均效益和资产质量“双优银行”。

18年来，北京银行积极履行社会责任，在医疗、教育、慈善、赈灾等方面向社会捐助超过1亿元，充分彰显了企业社会责任。凭借优异的经营业绩和优质的金融服务，北京银行赢得了社会各界的高度赞誉，先后荣获“全国文明单位”、“亚洲十大最佳上市银行”、“中国最佳城市商业零售银行”、“最佳区域性银行”、“最佳支持中小企业贡献奖”、“最佳便民服务银行”、“中国上市公司百强企业”、“中国社会责任优秀企业”、“最具持续投资价值上市公司”、“最受尊敬银行”、“最值得百姓信赖的银行机构”及“中国优秀企业公民”等称号。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

名称:中信建投基金管理有限公司

住所:北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

法定代表人:蒋月勤

办公地址:北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心E座2层

传真:010-59100298

电话:010-59100273

联系人:贾欣欣

客户服务电话:4009-108-108

网址:www.cfund108.com

2、其他销售机构

（1）北京银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街甲17号

办公地址:北京市西城区金融大街甲17号

法定代表人:闫冰竹

联系人:王曦

客户服务电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

（2）中信建投证券股份有限公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市东城区朝内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:权唐

客户服务电话:95587、400-8888-108

网址:www.csc108.com

3、各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

二、登记机构

名称:中信建投基金管理有限公司

住所:北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

法定代表人:蒋月勤

办公地址:北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心E座2层

电话:010-59100228

传真:010-59100298

联系人:陈莉君

三、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

住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人:俞卫锋

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:黎明、孙睿

联系人:孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城，东三办公楼16层

首席合伙人:吴港平

电话:010-58153000

传真:010-85188285

联系人:贺耀

经办注册会计师:李慧民、贺耀

第四部分 基金的名称

中信建投稳利保本混合型证券投资基金

第五部分 基金类型

混合型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、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）、货币市场工具、权证、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，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产，稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等，其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等。

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:债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%，其中基金应保留不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%。

第八部分 基金的投资策略

一、投资策略

本基金运用恒定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称CPPI策略），动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。

1、大类资产配置策略

本基金在大类资产配置上采取CPPI策略对稳健资产和风险资产进行配置，动态调整稳健资产与风险资产投资的比例，来实现保本和增值的目标。具体来说，该策略通过对稳健资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对风险资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。

结合CPPI策略，本基金对稳健资产和风险资产的资产配置可分为以下四步:

第一步，确定价值底线（Floor）。根据本基金保本周期到期时投资组合的最低目标价值（本基金的最低保本值为投资本金的100%）和合理的贴现率，确定当前应持有的稳健资产数额，亦即价值底线（Floor）。

第二步，计算安全垫（Cushion）。通过计算基金投资组合现时净值超越价值底线的数额，得到安全垫（Cushion）。

第三步，确定风险乘数（Multiplier）。本基金通过对宏观经济和证券市场运行状况和趋势的判断，并结合风险收益情况，确定投资过程中安全垫的放大倍数，也就是风险乘数，并在安全垫和风险乘数确定的基础上，得到当期风险资产的最高配置比例。

第四步，动态调整稳健资产和风险资产的配置比例，并结合市场实际运行态势制定风险资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上的保值增值。

CPPI 投资配置策略示例:

假设本基金初始募集规模为10 亿元，当期两年期无风险利率为年化3.33%，本基金认购费率最高一档为1.0%，假设本基金份额保本周期到期日最低目标价值为人民币1.01 元/基金份额，则基金合同生效期初投资组合的价值底线为9.4595亿元（即:（1.01×10）/（1+3.33%）2= 9.4595），此时本基金的安全垫为0.5405亿元（10-9.4595=0.5405）。假设本基金运作首日，基金管理人根据市场状况确定的当期风险乘数为1，则本基金投资于风险资产的最高配置规模为0.5405亿元（0.5405×1=0.5405，1为放大倍数），初始投资于稳健资产的规模不低于9.4595亿元。

假设经过1年的运作，股票市场出现一定程度的上涨，本基金的净资产变为11亿元（假设期间不发生申购赎回），此时本基金投资组合的价值底线变为9.7745亿元（即:（1.01×10）/（1+3.33%）=9.7745），此时本基金的安全垫为1.2255亿元（11-9.7745=1.2255）。假设此时基金管理人根据市场状况确定的当期风险乘数为2，则本基金投资于风险资产的最高配置规模为2.4510亿元（1.2255×2=2.4510，2为放大倍数）。

2、稳健资产投资策略

本基金通过综合分析宏观经济运行趋势、财政政策、货币政策等，对市场的收益率走势及信用环境变化作出判断，并综合考虑不同债券品种收益率变化的阶段特征、具体、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等多种因素，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。

（1）免疫策略

本基金采用剩余期限与保本周期期限动态匹配的投资策略，参照保本周期的剩余期限，动态调整稳健资产债券组合久期，以有效控制利率变动风险，维护债券组合收益的稳定性。

（2）收益率曲线策略

本基金将结合对市场收益率曲线变化的研究，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造投资组合，并进行动态调整，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。

（3）相对价值策略

本基金通过对不同债券市场、债券品种及信用等级的债券间利差的分析判断，获取阶段性市场定价偏差所带来的投资机会。

（4）骑乘策略

本基金通过分析收益率曲线各期限利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，从而获得较高的期限利差带来的资本利得收入。

（5）回购策略

本基金将适时运用回购交易套利策略，在确保基金资产安全的前提下增强债券组合的收益率。

（6）信用债投资策略

本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法，通过对信用产品基本面的研究，形成对该信用产品信用级别综合评定，并通过调整组合内信用产品在信用等级和剩余期限方面的分布，获取超额收益。

3、风险资产投资策略

（1）股票投资策略

本基金将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，从行业和个股两方面进行分析研究，精选具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估或价格处于合理区间的股票，构建股票组合。

1）行业配置策略

本基金将密切关注国内外经济运行情况和国内各项政策，深入分析各行业的发展现状、景气走势及政策影响，对具有良好发展前景的行业，景气程度走高或处于拐点的行业，以及政策上充分获得现实支持的行业进行重点配置。

2）个股选择策略

本基金将坚持价值投资理念，立足于公司的财务状况和发展潜力，通过估值手段，对公司的价值进行合理判断，并结合股票的价格对其投资价值进行科学判断;同时，本基金将充分结合中国证券市场的自身特点和运行规律，发掘出投资价值被市场低估的投资品种，以获取优厚的投资回报。

（2）权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，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，追求基金资产稳定的当期收益。

（3）股指期货投资策略

本基金参与股指期货的投资以符合基金合同规定的保本策略和投资目标为前提进行。本基金以套期保值为目的，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，有效管理投资组合的系统性风险，积极改善组合的风险收益特征。

二、投资决策依据和投资程序

基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

1、投资决策依据

（1）有关法律、法规和基金合同的有关规定。

（2）经济运行态势和证券市场走势。

（3）投资对象的风险收益配比。

2、投资决策程序

（1）投资决策支持:研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究方案，向投资决策委员会提出宏观经济分析方案和投资策略方案等决策支持。

（2）投资原则的制定:投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的前提下，根据研究人员和基金经理的有关方案，决定基金投资的主要原则，对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

（3）研究支持:研究分析人员根据投资决策委员会的决议，为基金经理提供各类分析方案和投资建议;也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

（4）制定投资决策:基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则，根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出投资决策。

（5）风险控制与评估:风险管理委员会定期召开会议，听取投资研究部、基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估，并提出风险控制意见。

（6）组合的调整:基金经理有权根据环境的变化和实际的需要，在其权限范围内对组合进行调整，超出其权限的调整，需报投资决策委员会审批。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:两年期银行定期存款税后收益率。

两年期银行定期存款税后收益率指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率（按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位，单位为百分数）计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。

本基金是保本型基金，保本周期为两年，保本但不保证收益率。以两年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资者理性判断本基金的预期风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

如果今后法律法规发生变化，或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用，又或者市场出现更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月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2014年12月31日（摘自本基金2014年4季报），本报告中所列财务数据未经审计。

一、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	56,204,062.24	12.18
	其中:股票	56,204,062.24	12.18
2	固定收益投资	387,994,203.92	84.11
	其中:债券	387,994,203.92	84.11
	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	10,953,835.35	2.37
7	其他资产	6,121,039.11	1.33
8	合计	461,273,140.62	100.00

二、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	21,996,787.04	5.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,280,000.00	1.91
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	-	-
J	金融业	16,763,219.84	4.39
K	房地产业	5,519,055.36	1.45
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	4,645,000.00	1.22
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	56,204,062.24	14.72

三、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	000625	长安汽车	500,000	8,215,000.00	2.15
2	601668	中国建筑	1,000,000	7,280,000.00	1.91
3	600016	民生银行	500,568	5,446,179.84	1.43
4	601166	兴业银行	300,000	4,950,000.00	1.30
5	000978	桂林旅游	500,000	4,645,000.00	1.22
6	600837	海通证券	150,000	3,609,000.00	0.95
7	002531	天顺风能	233,436	3,566,902.08	0.93
8	002563	森马服饰	100,000	3,325,000.00	0.87
9	600741	华域汽车	200,052	3,096,804.96	0.81
10	600376	首开股份	295,442	2,978,055.36	0.78

四、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	20,004,000.00	5.24
	其中:政策性金融债	20,004,000.00	5.24
4	企业债券	90,437,451.00	23.70
5	企业短期融资券	119,211,000.00	31.23
6	中期票据	157,749,000.00	41.33
7	可转债	592,752.92	0.16
8	其他	-	-
9	合计	387,994,203.92	101.66

五、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	041461054	14协鑫CP002	300,000	29,826,000.00	7.81
2	1382132	13宇通MTN1	200,000	20,326,000.00	5.33
3	122068	11海螺01	200,000	20,084,000.00	5.26
4	122214	12大秦债	200,000	20,076,000.00	5.26
5	122227	13尖峰01	200,010	20,021,001.00	5.25

六、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。

七、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。

八、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。

九、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

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

十、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

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投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

十一、投资组合报告附注

1、期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体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、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（元）
1	存出保证金	31,733.05
2	应收证券清算款	1,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	5,089,306.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,121,039.11

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。

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	002531	天顺风能	3,566,902.08	0.93	重大事项

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

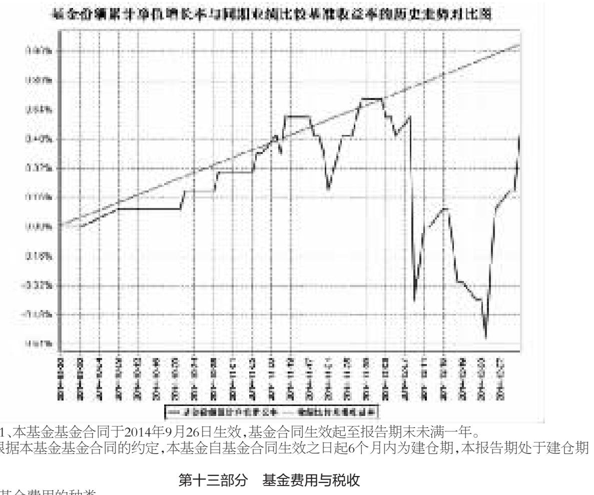
基金业绩截止日为2014年12月31日。

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。

一、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9月26日(基金合同生效日)至2014年12月31日	0.50%	0.17%	1.00%	0.01%	-0.50%	0.16%

二、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:1、本基金基金合同于2014年9月26日生效，基金合同生效起至报告期末未满一年。

2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内。

第十三部分 基金费用与税收

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、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1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.20%÷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、公休假等，支付日期顺延。到期期间和过渡期内本基金不计提管理费。

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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.20%÷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，支付日期顺延。到期期间和过渡期内本基金不计提托管费。

上述“一、基金费用的种类中第3－8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。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“中信建投稳利混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计提方法和支付方式同上。

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

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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《中信建投稳利保本混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下:

1、更新了“第三部分 基金管理人”的“主要人员情况”相关内容;

2、更新了“第四部分 基金托管人”的相关内容;

3、更新了“第七部分 基金的生效”的“基金合同的生效时间” 相关信息;

4、新增了“第十二部分 基金投资组合报告”，并经托管人复核;

5、新增了“第十三部分 基金的业绩”，并经托管人复核;

6、新增了“第二十六部分 其他应披露事项”，列示了本基金自成立以来的临时公告事项。

中信建投基金管理有限公司

2015年4月

证券代码:002688 证券简称:金河生物 公告编号:【2015-022】

金河生物科技股份有限公司
第三届监事会第十一次会议决议公告

本公司及监事会全体人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

金河生物科技股份有限公司（以下简称"公司"）第三届监事会第十一次会议于2015年5月6日以专人送达、传真等方式发出通知，并于2015年5月11日以现场及通讯方式召开。会议由监事会主席张千岁先生主持，应出席会议的监事3人，亲自出席会议的监事3人，会议的召开符合《公司法》、相关法律法规和《公司章程》的有关规定。与会监事以现场及通讯方式通过了以下议案:

以3票同意，0票反对，0票弃权审议通过了《关于选举张千岁先生为公司监事会主席的议案》。

监事会主席王志广先生因个人原因已辞去公司第三届监事会主席及监事职务，王志广先生辞职后不再担任公司任何职务。为保证公司监事会的正常运作，监事会成员一致同意张千岁先生（简历附后）为公司第三届监事会主席，任期自本次会议审议通过之日起至第三届监事会届满时止。

《关于选举张千岁先生为公司监事会主席的公告》（公告编号:2015-023） 详见巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）公告。

特此公告。

金河生物科技股份有限公司

监 事 会

2015年5月11日

张千岁先生:1956年出生，大专学历，高级工程师。历任内蒙古金河建筑安装有限责任公司副总经理兼总工程师。现任内蒙古金河建筑安装有限责任公司副总经理。

张千岁先生未持有公司股份。与实际控制人、公司其他董事、监事及高级管理人员不存在关联关系。张千岁先生担任公司控股股东内蒙古金河建筑安装有限责任公司副总经理。不存在《公司法》、《公司章程》中规定的不得担任公司监事的情形，没有受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒。

证券代码:002688 证券简称:金河生物 公告编号:【2015-023】

金河生物科技股份有限公司
关于选举张千岁先生为公司监事会主席的公告

本公司及监事会全体人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

金河生物科技股份有限公司（以下简称"公司"）监事会主席王志广先生因个人原因已辞去公司第三届监事会主席及监事职务，王志广先生辞职后不再担任公司任何职务。

2015年5月5日召开的2014年度股东大会，选举张千岁先生为公司第三届监事会股东代表监事。2015年5月11日，第三届监事会第十一次会议审议通过了《关于选举张千岁先生为公司监事会主席的议案》，监事会成员一致同意张千岁先生（简历附后）为公司第三届监事会主席，任期自本次会议审议通过之日起至第三届监事会届满时止。

特此公告。

金河生物科技股份有限公司

监 事 会

2015年5月11日

张千岁先生:1956年出生，大专学历，高级工程师。历任内蒙古金河建筑安装有限责任公司副总经理兼总工程师。现任内蒙古金河建筑安装有限责任公司副总经理。

张千岁先生未持有公司股份。与实际控制人、公司其他董事、监事及高级管理人员不存在关联关系。张千岁先生担任公司控股股东内蒙古金河建筑安装有限责任公司副总经理。不存在《公司法》、《公司章程》中规定的不得担任公司监事的情形，没有受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒。

证券代码:002688 证券简称:金河生物 公告编号:【2015-024】

金河生物科技股份有限公司
关于控股子公司完成工商登记的公告

本公司及董事会全体人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

金河生物科技股份有限公司（以下简称"公司"）第三届董事会第十三次会议审议通过了《关于投资设立控股子公司的议案》，具体内容详见2015年4月10日刊登在《证券时报》、《证券日报》、《中国证券报》、《上海证券报》及巨潮资讯网 (www.cninfo.com.cn)上的相关公告。

日前，公司控股子公司内蒙古金河生物制品有限公司完成了工商注册登记手续，取得了呼和浩特市工商行政管理局颁发的《企业法人营业执照》，相关登记信息如下:

名称:内蒙古金河生物制品有限公司

注册号:150100000070358

住所:内蒙古自治区呼和浩特市新城区兴安北路东公铁立交桥北侧鼎盛华世纪广场一期写字楼22楼

法定代表人:张兴明

注册资本:2,000万元

公司类型:其他有限责任公司

经营范围:兽用生物制品的研发、生产、销售和技术服务;疫苗稀释液、血清制品、疫苗培养基、免疫增强剂、疫苗佐剂、冻干疫苗耐热保护剂、兽用器械、塑料制品的销售。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

特此公告。

金河生物科技股份有限公司

董 事 会

2015年5月11日

证券代码:002212 证券简称:南洋股份 公告编号:2015-021

广东南洋电缆集团股份有限公司
关于筹划发行股份购买资产的停牌公告

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、停牌时间与进展安排

广东南洋电缆股份有限公司（以下简称"公司"） 因筹划重大事项，公司股票（证券简称:南洋股份，证券代码:002212）自2015年4月27日开市起停牌。公司分别于2015年4月28日、2015年5月5日发布了《重大事项停牌公告》、《关于重大事项进展暨股票继续停牌公告》。

公司现确定正在筹划的重大事项为发行股份购买资产事项，经公司申请，公司股票自2015年5月12日（周二）开市起继续停牌。公司承诺争取停牌时间不超过30个自然日，即承诺争取在2015年6月12日前披露符合《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第26号—上市公司重大资产重组申请文件》要求的发行股份购买资产预案（或报告书），公司股票将在公司董事会审议通过并公告发行股份购买资产预案（或报告书）后复牌。

如公司未能在上述期限内披露发行股份购买资产预案（或报告书），公司将根据重组推进情况确定是否向交易所申请延期复牌。公司未提出延期复牌申请或延期复牌申请未获交易所同意的，公司股票将于2015年6月12日开市时起复牌，公司承诺自公司股票复牌之日起三个月内不再筹划重大资产重组事项。公司提出延期复牌申请并获交易所同意的，公司承诺累计停牌时间不超过3个月，如公司仍未能在延期期限内披露发行股份购买资产预案（或报告书），公司承诺自公司股票复牌之日起六个月内不再筹划重大资产重组事项。

如公司在停牌期限内终止筹划发行股份购买资产事项的，公司将及时披露终止筹划发行股份购买资产相关公告，公司承诺自复牌之日起三个月内不再筹划重大资产重组事项，公司股票将在公司披露终止筹划发行股份购买资产相关公告后恢复交易。

公司股票在停牌期间，将根据相关规定，每五个交易日发布一次本次发行股份购买资产事项进展情况公告。

本公司公司债（证券简称:13南洋债;证券代码:112179）在公司股票停牌期间正常交易。

二、风险提示

公司筹划的发行股票购买资产事项，尚存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

三、备查文件

经董事长签字及董事会盖章的停牌申请。

特此公告

广东南洋电缆集团股份有限公司董事会

二〇一五年五月十二日

证券代码:002342 证券简称:巨力索具 公告编号:2015-024

巨力索具股份有限公司
关于控股股东签订股票质押式回购交易协议的公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

巨力索具股份有限公司（以下简称"本公司"）于2015年5月11日收到控股股东巨力集团有限公司（以下简称"巨力集团"）通知，2015年5月8日巨力集团与中信证券股份有限公司签订了《股票质押式回购交易协议书》，同意将其持有的本公司无限售条件的流通股52,000,000股质押给中信证券股份有限公司，用于办理股票质押式回购业务;本次股份质押初始交易日为2015年5月7日，购回交易日为2016年5月7日，回购期限为365天;该股份在质押期间予以冻结，不能转让。

截至2015年5月11日，巨力集团共持有本公司股份192,300,000股，占本公司总股本的20.0313%;本次质押股份52,000,000股，占巨力集团持有公司股份的27.0411%，占公司总股本的5.4167%;累计质押192,170,000股，占巨力集团持有公司股份的99.9324%，占公司总股本的20.0177%。

备查文件

1、《股票质押式回购交易协议书》。

特此公告。

巨力索具股份有限公司

董事会

2015年5月12日

新华优选分红混合型证券投资基金
关于调整分红点的公告

中国人民银行决定，自2015年5月11日起下调金融机构人民币存贷款基准利率。金融机构一年期存款基准利率下调0.25个百分点，由现行的2.5%降低到2.25%，根据《新华优选分红混合型证券投资基金招募说明书（更新）》和《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金的分红点为中国人民银行一年期定期存款利率的两倍，并随中国人民银行一年期定期存款利率的变动而调整，因此本基金分红点自公告之日起降低至4.5%。

特此公告。

新华基金管理有限公司

2015年5月12日

证券代码:002423 证券简称:中原特钢 公告编号:2015-028

中原特钢股份有限公司
关于高级管理人员辞职的公告

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

中原特钢股份有限公司（以下简称"公司"）董事会于2015年5月11日收到高级管理人员张会明先生递交的书面辞呈。张会明先生因分管工作需要，请求辞去公司副总经理职务，辞职后继续担任公司党委副书记、纪委书记职务。张会明先生的辞职自2015年5月11日起生效。

特此公告。

中原特钢股份有限公司董事会

2015年5月12日