

(上接B42版)

3. 报告期末的投资组合符合基金合同约定的保本策略和投资目标,本基金以保值增值为目的,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,有效投资组合的风险收益特征。

4. 本基金的风险控制策略

本基金通过对宏观经济和股票市场走势的分析与判断,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎操作,分散投资,以降底投资组合的整体风险。其风险在于:本基金股指期货投资合约标的公允价值与股指期货合约公允价值之间存在差异,且两者在到期时可能存在盈亏,因此本基金在运用股指期货对冲的基础上,将择机获取相应的超额收益,通过股指期货对股票的多头替代和避险平仓位增加,实现可转移阿尔法,并通过股指期货与股票的多空比例调整,获取风险资产的选股阿尔法。

本基金管理人针对股指期货交易制订了严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位职责。此外,基金管理人建立股指期货交易决策小组,并授权该决策小组人员负责股指期货的投资决策事项。

本基金的业绩比较基准采用:三年期银行定期存款后收益率。

三年期银行定期存款后收益率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的存款利率。

十、基金的投资业绩比较

本基金保本保本基金,保本周期为三年,保本不保证收益。以三年期银行定期存款后收益率为本基金业绩比较基准,合理衡量保本基金的保本程度,并能使本基金保本受益人合理判断本基金的风险收益特征,合理衡量与保本基金保本保障的有效性。

本基金投资业绩比较基准采用:三年期银行定期存款后收益率。

三年期银行定期存款后收益率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的存款利率。

十一、基金的风险收益特征

本基金是一只保本型投资品种,在证券投资基金中属于低风险品种。

十二、基金的投资组合报告

本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。

本基金管理人可收回或变更本报告期限,在本基金合同规定范围内,于2015年10月26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,保证报告内容真实、准确,本报告资料未尝虚假记载。

本报告期内为2015年7月1日至2015年9月30日。本报告投资组合资料未经审计。

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	140445	14广发45	400,000	41,676,000.00	17.96
2	140402	14广发02	300,000	32,172,000.00	13.87
3	140468	14广发68	300,000	30,531,000.00	13.16
4	140439	14广发39	200,000	21,042,000.00	9.07
5	150005	15国债05	200,000	20,268,000.00	8.74

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

报告期末本基金投资的股指期货交易如下:

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除13广信01(证券代码:122266)外,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、处罚的情况。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中,除13广信01(证券代码:122266)的发行主体中信证券于2015年1月18日公告称,或存在与到期调整债券合同约定的问题,被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

(3) 本基金管理人对该证券投资决策过程的说明如下:本基金管理人对该证券投资特别是重仓个券的投资行为投资决策流程,本基金在对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在该证券的选择上,严格执行公司内幕交易政策,在该证券的持有过程中研究员密切关注该证券的公开发布信息。在上述证券发生时及时分析研究,并经集体讨论分析后决策,经投资决策委员会批准,并经基金经理确认,经投资决策委员会批准后,再行决策。

(4) 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

(5) 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	74,470,500.52	29.35
其中:股票	74,470,500.52	29.35	
2	固定收益投资	167,002,200.00	65.82
其中:债券	167,002,200.00	65.82	
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	4,828,478.70	1.90
7	其他资产	74,867,674.46	2.91
8	合计	253,739,786.66	100.00

2. 报告期末按资产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	医药、生物制品	2,088,000.00	0.90
C	制造业	43,081,055.52	18.57
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	1,770,400.00	0.76
E	建筑业	1,365,000.00	0.59
F	信息技术业	2,094,000.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	2,094,000.00	0.86
H	房地产业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,633,245.00	0.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,168,600.00	1.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	609,000.00	0.26
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	751,200.00	0.32
S	综合	-	-
合计	-	74,470,500.52	32.10

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	双林股份	338,700	4,868,047.00	2.10
2	同智科技	80,000	4,216,800.00	1.82
3	通发股份	380,000	3,636,600.00	1.57
4	曙光信息	50,000	3,488,500.00	1.50
5	中国重工	300,000	3,003,000.00	1.29
6	兆拓科技	200,000	2,630,000.00	1.13
7	瑞航软件	300,000	2,535,000.00	1.09
8	国望精工	44,773	2,265,315.00	0.99
9	聚源信息	40,000	2,115,600.00	0.91
10	三昌新材	71,100	2,093,895.00	0.90

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权证投资明细

序号	股票名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国富转债	-	-	-
2	奥普转债	-	-	-
3	金鼎转债	145,689,000.00	62.79	
4	金鼎转债	145,689,000.00	62.79	
5	金鼎转债	11,222,200.00	4.84	
6	中债转债	-	-	
7	中债转债	-	-	
8	中债转债	-	-	
9	其他	10,091,000.00	4.35	
10	合计	167,002,200.00	71.98	

阶段	净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准超越率③	超额收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-12.65%	1.44%	0.81%	0.01%	-13.46%	1.43%
过去六个月	21.02%	0.89%	1.89%	0.01%	19.33%	0.88%
过去一年	17.80%	0.40%	4.28%	0.01%	13.52%	0.39%

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合基金合同的投资范围和投资比例的约定。

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	145,689,000.00	62.79
4	企业债	145,689,000.00	62.79
5	可转债	11,222,200.00	4.84
6	中期票据	-	-
7	短期融资券	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	10,091,000.00	4.35
10	合计	167,002,200.00	71.98

5. 报告期末按资产分类的债券投资组合

本基金管理人认为,本基金资产配置比例符合基金合同的投资范围和投资比例的约定。

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	双林股份	338,700	4,868,047.00	2.10
2	同智科技	80,000	4,216,800.00	1.82
3	通发股份	380,000	3,636,600.00	1.57
4	曙光信息	50,000	3,488,500.00	1.50
5	中国重工	300,000	3,003,000.00	1.29
6	兆拓科技	200,000	2,630,000.00	1.13
7	瑞航软件	300,000	2,535,000.00	1.09
8	国望精工	44,773	2,265,315.00	0.99
9	聚源信息	40,000	2,115,600.00	0.91
10	三昌新材	71,100	2,093,895.00	0.90

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合基金合同的投资范围和投资比例的约定。

十、基金的投资业绩比较

本基金保本保本基金,保本周期为三年,保本不保证收益。以三年期银行定期存款后收益率为本基金业绩比较基准,合理衡量保本基金的保本程度,并能使本基金保本受益人合理判断本基金的风险收益特征,合理衡量与保本基金保本保障的有效性。

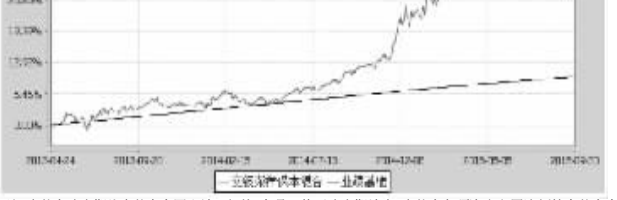
本基金投资业绩比较基准采用:三年期银行定期存款后收益率。

三年期银行定期存款后收益率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的存款利率。

阶段	净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准超越率③	超额收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-12.65%	1.44%	0.81%	0.01%	-13.46%	1.43%
过去六个月	21.02%	0.89%	1.89%	0.01%	19.33%	0.88%
过去一年	17.80%	0.40%	4.28%	0.01%	13.52%	0.39%

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合基金合同的投资范围和投资比例的约定。

阶段	净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准超越率③	超额收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-12.65%	1.44%	0.81%	0.01%	-13.46%	1.43%
过去六个月	21.02%	0.89%	1.89%	0.01%	19.33%	0.88%
过去一年	17.80%	0.40%	4.28%	0.01%	13.52%	0.39%



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各资产配置比例符合基金合同的投资范围和投资比例的约定。

十四、基金的费用与税收

(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. 基金合同生效后的信息披露费用;

4. 基金合同生效后的会计师费、律师费和其他费用;

5. 基金持有人大会费用;

6. 基金的销售费用;

7. 基金的银行账户费用;

8. 基金的开户费用、账户维护费用;

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. 与基金运作有关的费用

(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1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.2\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日基金资产净值

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3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延最近支付日。

(2) 基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日基金资产净值

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3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延最近支付日。

(3) 销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金管理费、基金托管费、销售服务费均通过基金管理人的基金托管人免收基金管理和基金托管费。

(4) 本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

(5) 若本周期到期后,本基金不符合保本条件但符合法律法规和基金合同约定基金的存续要求,本基金根据基金合同约定变更为“交银罗锦瑞稳健收益增强证券投资基金”后,基金管理费率、基金托管费率、销售服务费按变更前一日基金资产净值的0.2%年费率计提,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

申购费(含申购费)	申购费率
50万元以下	1.2%
50万元(含)至100万元	1.0%
100万元(含)至200万元	0.8%
200万元(含)至500万元	0.6%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金的销售服务费由基金持有人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

在本基金的保本周期期间,投资人可以多次申购本基金,申购费率按单笔申购金额计算,申购费率如下:

申购费(含申购费)	申购费率
50万元以下	1.2%
50万元(含)至100万元	1.0%
100万元(含)至200万元	0.8%
200万元(含)至500万元	0.6%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

申购费(含申购费)	申购费率
50万元以下	1.2%
50万元(含)至100万元	1.0%
100万元(含)至200万元	0.8%
200万元(含)至500万元	0.6%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

申购费(含申购费)	申购费率
50万元以下	1.2%
50万元(含)至100万元	1.0%
100万元(含)至200万元	0.8%
200万元(含)至500万元	0.6%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

注:本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

本基金在申购期间(除本周期到期日)和过渡期间,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

证券代码:600151 证券简称:航天机电 编号:2015-080

上海航天汽车机电股份有限公司

第六届董事会第十八次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告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

2015年12月8日,上海航天汽车机电股份有限公司第六届董事会第十八次会议通知及会议材料以书面形式送达全体董事。会议于2015年12月7日以通讯方式召开,由董事长李先先生主持,应到董事9名,亲自出席的董事9名。本次会议出席人数符合《公司法》及公司章程的有关规定,公司董事长及相关人员均列席了会议。本次会议的召开符合有关法律、行政法规和公司章程的规定。

二、董事会会议决议情况

《关于全资子公司向航天融资租赁有限公司申请分布式光伏电站项目融资租赁的议案》

为落实航天汽车机电商业模式,拓宽融资租赁渠道,提高资金使用率,提升项目自身盈利能力,公司以全资子公司上海耀阳光电电力有限公司为分布式光伏电站项目的光伏租赁,向航天融资租赁有限公司申请项目融资租赁,租赁金额792万元。公司独立董事发表了独立意见。

详细请阅读披露的《关联交易公告》(2015-081)。

上海航天汽车机电股份有限公司
董事会
二〇一五年十二月八日

证券代码:600151 证券简称:航天机电 编号:2015-081

上海航天汽车机电股份有限公司

关联交易公告

本公司董事会及全体董事保证本公告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:

● 12月7日公司与同一关联人进行的交易,以及与不同关联人进行交易类别不同的交易均已经公司董事会或股东大会批准,并按按照《上海证券交易所上市公司关联交易实施规则》予以公告

● 关联交易无须提交股东大会审议

一、关联交易概述

上海耀阳光电电力有限公司(以下简称“上海耀阳”)为公司全资分布式项目公司。上海耀阳拟以分布式光伏电站1.98MW项目的光伏组件,向航天融资租赁有限公司(以下简称“航天融资租赁”)申请项目融资租赁,租赁金额792万元。不超过自有资金规模的50%,租赁期限为365天,融资租赁业务不涉及与关联方非关联融资,租金收益采用净额支付,按照站在租赁期内的发生时点进行计提。

鉴于航天融资租赁与本公司属同一实际控制人中国航天科技集团公司,根据《上海证券交易所股票上市规则》的规定,本次交易涉及事项构成关联交易。

二、关联交易的主要内容

1. 交易概述

2. 交易各方

3. 交易标的

4. 交易目的

5. 交易定价

6. 交易授权

7. 关联交易对公司的影响

8. 关联交易的其他说明

上海航天汽车机电股份有限公司
董事会
二〇一五年十二月八日

证券代码:002576 证券简称:唐人神 公告编号:2015-111

唐人神集团股份有限公司

关于湖南唐人神控股投资股份有限公司办理股票质押式回购交易的公告

质押期限为1年,质押期间该股权质押以冻结不能转让。

二、累计公告被披露情况

截至本公告披露日,唐人神控股持有公司股票11,600,389.97股,占公司总股本(49,319,548.5万股)的23.70%,累计质押900.96万股(含本次),质押期间占公司总股本的20.07%。

三、备查文件

1、《湖南唐人神控股投资股份有限公司关于办理股票质押式回购交易的告知函》;

2、《股份质押回购数据表》(中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司)(2015.12.04);

3、《股份冻结数据表》(中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司)(2015.12.04)。

特此公告。

唐人神集团股份有限公司
董事会
二〇一五年十二月七日

证券代码:002309 证券简称:中利科技 公告编号:2015-155

中利科技集团股份有限公司

关于筹划发行股份购买资产的停牌进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实性、准确性和完整性,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

中利科技集团股份有限公司(以下简称“公司”)因筹划发行股份购买资产事项,经公司申请,公司股票(股票代码:中利科技,股票代码:002309)已按照相关规定自2015年11月24日(星期二)上午9时停牌(公告编号:2015-148)。并于2015年12月1日披露了《关于筹划发行股份购买资产的停牌进展公告》(公告编号:2015-153)。

截至本公告发布之日,各方中介机构尚在积极推进尽职调查等工作,交易各方涉及的事项仍需要与有关各方进行持续沟通。为维护广大投资者的合法权益,经公司申请,公司股票将继续停牌,直至交易各方所股票上市规则的相关规定,经公司申请股票上市(2015.12.8(周二))上午9时复牌(停牌公告编号:2015-155)。

停牌期间,公司将根据相关法律法规履行信息披露义务,并及时履行信息披露义务,并至少每5个交易日发布一次事项的进展公告,直至相关事项确定并披露有关结果后复牌。

风险提示:公司本次筹划的发行股份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。特此公告。

中利科技集团股份有限公司
董事会
2015年12月7日

股票简称:国栋建设 股票代码:600321 编号:2015-042

四川国栋建设股份有限公司

关于控股股东股票解除质押的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告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。

四川国栋建设股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年12月07日接到公司控股股东四川国栋建设集团有限公司(以下简称“国栋集团”)的通知,国栋集团将其质押给德盛的国栋建设(股票代码:600321)16,500万股无限售流通股解除质押。相关情况已于2015年12月04日在中国证券登记结算有限公司上海分公司办理了质押登记手续解除。

国栋集团持有公司股份687,370,570股,占公司总股本的45.53%。截至本公告日,国栋集团累计质押614,670,000股,占公司总股本的40.69%。

特此公告。

四川国栋建设股份有限公司
董事会
2015年12月08日

证券代码:600448 证券简称:亨通