

**(上接B50版)**

3.场内认购机构  
投资者可通过“工银基金A类份额(基金代码:519121)和C类份额(基金代码:519123)的上海证券交易所场内认购,“工银基金”业务资料的获取具体可在上海证券交易所网站查询。如果上海证券交易所增或减少具有“工银基金”业务资料的证券公司,请以上海证券交易所的具体规定为准。

(二)法律意见书  
名称:中国普华永道会计师事务所  
办公地址:北京市西城区太平门大街17号  
法定代表人:李明  
联系人:董晓  
电话:(010)59398856  
传真:(010)59398907

(三)会计师事务所和经办律师  
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
办公地址:上海市静安区南京西路580号南京大厦45-46层  
负责人:倪建刚  
电话:(021)62214668  
传真:(021)62216990  
联系人:丁娜  
经办律师:宣伟华、丁娜  
(四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师  
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号周亚酒店大厦6楼  
办公地址:上海市湖北路202号普华永道中心11楼  
法定代表人:杨彬  
电话:(021)22328888  
联系人:董晓  
经办注册会计师:薛彦、董晓

(五)其他服务机构及提供力服务的有关情况  
中国工商银行由信息技术系统运维系统以及相关业务应用系统运维、信息技术系统运维系统包括机房工程系统、网络集成系统,这些系统均由工行专业的系统集成公司负责建设,之后日常维护管理由工行负责,但与第三方服务公司签订技术服务合同,由其提供定期的巡检和特殊情况下技术支持,公司业务应用系统包括开放式基金资产过户系统、清算系统、资金清算系统、投交交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、数据数据中心等系统,这些系统主要是在工商银行之内部专业系统提供的技术支持而成,也是工商银行在业务过程中与中国工商银行系统进行了相关的系统功能升级,升级后系统提供负责,升级后的系统提供对外提供通用系统,对外提供通用系统日常维护管理由工行负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下技术支持,除上述情况外,公司未聘请服务机构作为主要服务的,特定的信息技术系统开发、维护服务等。

(六)其他服务机构及提供力服务的有关情况  
根据业务发展战略的需要,委托优质的金融服务机构作为基金份额赎回、估值核算等业务。

**四、基金名称**  
浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金

**五、基金类型**  
债券型证券投资基金

**六、基金投资目标**  
在控制风险的基础上,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资收益回报,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。

**七、基金投资策略**  
本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、可转换债券、公司债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债、质押及买断式回购、协议存款、定期存款、通知存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他固定收益品种(但债券品种的信用等级须符合相关规定)。

本基金不从二级市场买入股票、权证及权益类资产,也不参与一级市场的申购和增发新股。本基金可采用有锁转债转股形成的转股,以及及投资可转债而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证,其比例不得超过基金资产净值的2%,且本基金投资于可转债的资产,本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,且在每个开放期前一个月、开放期及开放期后的一个月期间内,本基金不受上述比例限制;开放期内,本基金不受以上比例限制;开放期结束后,本基金按照有效的法律法规和合同约定调整。

**八、基金资产配置策略**  
(一)资产配置策略  
在封闭期内,本基金采取灵活的资产配置策略,兼顾产品流动性,追求稳健收益。本基金主要投资于银行存款及大额存单、债券和中期票据(包括短期融资券,即将到期的中期票据等)。每个封闭期,将根据收益率、市场流动性、信用风险等因素,对中期票据与短期融资券,以及可转债和中期票据等进行比较,并在对中期票据进行判断的基础上,判断是否存在利差,以确定是否进行可转债操作,确定优先配置的资产类别,并结合各货币市场工具的市场容量,确定配置比例。

(二)久期资产配置策略  
买入并持有策略是对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余到期期限进行匹配,主要投资于剩余期限(或回购期限)不超过基金剩余到期期限的固定收益类资产。

(三)利率投资策略  
本基金将在考虑债券投资的利率风险情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。

为控制风险,本基金在杠杆比例结合市场环境有所调整,在回购利率过高、流动性不足,或者市场环境不况采用放大策略等情况下,本基金管理人可调整杠杆比例或者不进行杠杆操作。

本基金将在封闭期内进行杠杆投资,杠杆大部分将主要用于投资于剩余期限(或回购期限)不超过基金剩余到期期限的固定收益类工具,并采取买入并持有到期的策略,同时采取滚动回购的方式来维持杠杆,因负债的成本存在一定程度的波动。

(四)固定收益类资产及大额存单投资策略  
按照期限、本基金的利率品种选择,可以对银行进行定期存款和大额存单的投资。

(五)债券回购投资策略  
首先,基于对封闭期内资产面走势的判断,确定回购期限的选择。在组合进行杠杆操作时,若判断资金面趋于宽松,则选择期限较短的回购品种;反之,则选择长期限的回购品种,提前锁定成本。若判断资金面趋于紧张,则在判断资金面紧张的前提下,优先选择期限较短的回购品种,反之,则选择长期限的回购品种。其次,本基金在每个封闭期前,根据资金头寸,安排相应期限的回购操作。

(六)中期票据投资策略  
本基金管理人将分析所有发行主体的信用状况、中期票据信用债发行人的研究和发行,在每个封闭期运作期间,基金管理人根据市场情况,分析发行主体信用,形成本基金的投资,根据各短期信用债的到期收益率、剩余期限与运作周期的匹配程度,选择适当的债券进行配置。

(七)高流动性策略  
本基金将选择组合久期并定期进行调整,以匹配基金资产。

(八)中小企业私募债券投资策略  
中小企业私募债券具有利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差,中小企业私募债券强制第三方评级,基金管理人通过内部信用分析系统,分析发债主体的信用水平及个体偿债措施,量化比较信用评级,精选优质标的,进行分散投资。信用分析系统充分考虑发债主体的偿债能力、担保水平、增信措施等因素,对中小企业私募债券的发行人的财务状况、偿债能力和未来偿债能力、债券增信措施进行量化评价,同时结合企业实地调研,上市公司财务报表等数据考察,对债券风险收益进行综合评价。

(九)基金资产变现策略  
本基金在封闭运作期间,主要目标是降低基金净值的下行风险,基金投资的资产可以变现,以保持分享股票升值的收益能力。

(十)风险控制策略  
本基金在封闭运作期间,是否可借债投资的关键因素。本基金将采取积极投资策略,重视对可转债对股票资产的分析与研判,选择具有上升空间且景气趋势良好、成长性佳、估值水平偏低且具有较强持续性的转债进行投资,获取收益。

(二)一般市场申购策略  
目前,申购市场采取定价发行,对于那些发行条款优惠、期权价值较高,公司基本面优良的可转债,因供求不平衡,会产生折价,一旦折价幅度较大,且估值水平偏低,为增加组合收益,本基金将在充分研究的基础上,参与可转债申购,在严格控制风险的前提下获得定价收益。

**九、投资业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率\*60%+沪深300指数收益率\*40%

**十、基金的风险收益特征**  
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于股票基金和混合型基金。

| 序号 | 权益投资     | 金额             | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|----------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资     | 929,500.00     | 0.52          |
|    | 其中:股票    | 929,500.00     | 0.52          |
| 2  | 基金投资     | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资   | 167,283,672.31 | 94.31         |
|    | 其中:债券    | 167,283,672.31 | 94.31         |
| 4  | 资产支持证券   | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资  | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 应收股利     | -              | -             |
| 8  | 应收利息     | 3,944,570.73   | 2.22          |
| 9  | 其他资产     | 177,383,044.37 | 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       | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|------------------|------------|---------------|
| A  | 农林、牧、渔业          | -          | -             |
| B  | 采矿业              | -          | -             |
| C  | 制造业              | -          | -             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -             |
| E  | 建筑业              | -          | -             |
| F  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -             |
| G  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -          | -             |
| H  | 批发和零售业           | -          | -             |
| I  | 金融业              | 929,500.00 | 0.81          |
| J  | 房地产业             | -          | -             |
| K  | 租赁和商务服务业         | -          | -             |
| L  | 科学研究和技术服务业       | -          | -             |
| M  | 水利、环境和公共设施管理业    | -          | -             |
| N  | 居民服务、修理和其他服务业    | -          | -             |
| O  | 教育               | -          | -             |
| Q  | 卫生和社公工作          | -          | -             |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -          | -             |
| S  | 综合               | -          | -             |
|    | 合计               | 929,500.00 | 0.81          |

## 天弘基金管理有限公司关于增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告

根据天弘基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与中证金牛(北京)投资咨询有限公司(以下简称“金牛理财”)签署的相关基金销售服务协议,自2015年12月29日起,本公司增加金牛理财为旗下部分基金的代销机构并开通定期定额投资(以下简称“定投”)及转换业务。同时,本公司与金牛理财协商一致,决定自该日起,旗下部分基金参加金牛理财的费率优惠活动。

**一、适用的费率范围**  
通过金牛理财指定平台申购、赎回、定投或转换本公司旗下部分基金且符合基金合同约定的投资者。

**二、适用的基金范围**

| 基金名称                   | 基金代码      | 是否开通申购/赎回 | 是否开通定投 | 是否开通转换 |
|------------------------|-----------|-----------|--------|--------|
| 天弘沪深300指数型发起式证券投资基金    | 000961    | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证500指数型发起式证券投资基金    | 000962    | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金  | A类:001550 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金  | A类:001560 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证保险指数型发起式证券投资基金     | A类:001552 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证运输指数型发起式证券投资基金     | A类:001554 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金  | A类:001556 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证大宗商品指数型发起式证券投资基金   | A类:001558 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘创业板指数型发起式证券投资基金      | A类:001592 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金 | A类:001599 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证银行指数型发起式证券投资基金     | A类:001594 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘上证50指数型发起式证券投资基金     | A类:001548 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证100指数型发起式证券投资基金    | A类:001586 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证800指数型发起式证券投资基金    | A类:001588 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金   | A类:001590 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证电子产业指数型发起式证券投资基金   | A类:001617 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金    | A类:001629 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金   | A类:001631 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |
| 天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金   | A类:001611 | 是         | 是(注)   | 是(注)   |

注:上述19只指数基金目前仅支持办理相互之间的基金转换业务,暂未开通其与本公司其他开放式基金之间的基金转换业务。

**三、优惠活动内容**  
自2015年12月29日起,投资者通过金牛理财指定平台申购(含定投、转换转入)上述基金的,原申购费率高于0.6%的,享受4折优惠,但最低优惠至0.6%;原申购费率等于或低于0.6%的或为固定费率的,不享受优惠,按照原费率执行。各基金原申购费率请见各基金《基金合同》、招募说明书等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

**四、重要提示:**  
1.定投业务的申请方式、扣款金额、扣款日期、扣款方式、申购费率、交易确认、变更与解约等均适用各基金《基金合同》、招募说明书、《招募说明书(更新)》以及金牛理财的相关业务规定。  
2.各基金遵循的转换业务规则详见本公司2014年12月15日披露的《天弘基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告》。  
3.投资者欲了解各基金的详细情况,请仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书等法律文件。  
4.上述相关业务的办理规则及优惠活动的具体内容请以金牛理财的规定、公告或通知为准。  
5.本公告的解释权归本公司所有。  
投资者可以通过以下途径咨询有关情况:  
1.天弘基金管理有限公司  
客服热线:400-710-9999  
网站:www.thfund.com.cn  
2.中证金牛(北京)投资咨询有限公司  
客服热线:010-59336512  
网站:www.jnlc.com  
风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资本公司管理的基金时,应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,并关注投资风险。

特此公告。  
天弘基金管理有限公司  
二〇一五年十二月二十九日

## 兴业丰利债券型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2015年12月29日

**1. 公告基本信息**

| 基金名称    | 兴业丰利债券型证券投资基金 |
|---------|---------------|
| 基金简称    | 兴业丰利债券        |
| 基金代码    | 002268        |
| 基金运作方式  | 契约型开放式        |
| 基金合同生效日 | 2015年12月28日   |
| 基金管理人名称 | 兴业基金管理有限公司    |
| 基金托管人名称 | 招商证券股份有限公司    |

其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况  
其中:募集期间基金管理人从从业人员认购本基金情况

| 认购的基金份额(单位:份) | 占基金总份额比例 |
|---------------|----------|
| 0             | 0.00%    |
| 16794.32      | 0.084%   |

注:①按照有关法律法规规定,本基金基金合同生效所发生的律师费、会计师费、信息披露费用等由基金管理人承担,不在基金财产中列支。  
②本公司高级管理人员、基金投资和研究人员主要负责持有该基金份额的数量区间为0。

**3. 其他需要提示的事项**  
1.自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。  
2.中基金合同的申购、赎回将于基金合同生效之日起3个月内开始办理,在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。  
特此公告。  
兴业基金管理有限公司  
2015年12月29日

## 川化股份有限公司关于国有产权无偿划转获得中国证监会核准批复的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
川化股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年12月28日收到四川省能源投资集团有限责任公司(以下简称“能投集团”)书面来函获悉,中国证监会监督管理委员会下发了《关于核准四川省能源投资集团有限责任公司国有产权无偿划转川化股份有限公司国有产权的公告》(证监许可[2015]3007号),中国证监会批复如下:核准四川省能源投资集团有限责任公司因国有产权无偿划转而控制公司14,350万股,约占公司总股本的30.53%而应履行的要约收购义务。  
本次发行划转后,公司总股本仍为47,000万股,公司控股股东—四川化工控股(集团)有限责任公司(简称“四川化工”)持有公司股份14,350万股,占总股本比例为30.53%。能投集团

(一)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       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1  | 600016 | 民生银行 | 110,000 | 929,500.00 | 0.81         |

(二)报告期末按品种分类的股票投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国债债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,258,000.00  | 17.61        |
|    | 其中:政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 119,116,968.26 | 103.85       |
| 5  | 企业短期融资券   | 20,212,000.00  | 17.61        |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | 2,623,000.00   | 2.29         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | 5,022,904.11   | 4.38         |
| 10 | 合计        | 167,283,672.31 | 145.78       |

(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          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 124953    | 09广债     | 100,000 | 10,793,000.00 | 9.41         |
| 2  | 128804    | 12南农转债   | 100,000 | 10,640,000.00 | 9.24         |
| 3  | 150516    | 15南农转债   | 100,000 | 10,399,000.00 | 9.06         |
| 4  | 041460100 | 14晋普CP02 | 100,000 | 10,107,000.00 | 8.81         |
| 5  | 041454065 | 14晋普CP01 | 100,000 | 10,105,000.00 | 8.81         |

(四)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。

(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贵金属投资明细  
本基金本报告期末持有贵金属。

(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五名权证投资明细  
本基金本报告期末持有权证。

(七)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交易和损益情况  
本基金本报告期末未持有股指期货。  
2. 本基金股指期货投资的公允价值  
本基金本报告期末未持有股指期货。  
(一)股指期货投资情况说明  
1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。  
2. 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。  
3. 本基金股指期货投资的公允价值  
本基金本报告期末未持有股指期货。  
(二)股指期货投资情况说明  
1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。  
2. 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。  
3. 本基金股指期货投资的公允价值  
本基金本报告期末未持有股指期货。

(四)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

| 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  | 124953    | 09广债     | 100,000 | 10,793,000.00 | 9.41         |
| 2  | 128804    | 12南农转债   | 100,000 | 10,640,000.00 | 9.24         |
| 3  | 150516    | 15南农转债   | 100,000 | 10,399,000.00 | 9.06         |
| 4  | 041460100 | 14晋普CP02 | 100,000 | 10,107,000.00 | 8.81         |
| 5  | 041454065 | 14晋普CP01 | 100,000 | 10,105,000.00 | 8.81         |

(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权证投资明细  
本基金本报告期末持有权证。

(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五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末持有贵金属。

(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权证投资明细  
本基金本报告期末持有权证。

**十、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. 基金的销售服务费;  
4. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费;  
5. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;  
6. 基金份额持有人大会费用;  
7. 基金的投资交易费用;  
8. 基金的银行汇划费用;  
9. 基金开户费和银行帐户维护费;  
10. 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0.60%费率计提。  
H=H×0.60%÷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  
基金管理人应于每月月末,按上月末计提费用,由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、公休等,支付日期顺延。  
2. 基金托管人的托管费  
本基金托管人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=H×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  
基金管理人应于每月月末,按上月末计提费用,由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托管人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。  
3. 基金的销售服务费  
本基金A类基金份额的销售服务费率为0.25%,C类基金份额的销售服务费率为0.25%。本基金销售服务费专门用于本基金的基金份额持有人赎回时支付的手续费,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的开支情况作专项说明。  
销售服务费前一日C类基金资产净值的0.25%年费率计提。  
计算方法如下:  
H=H×0.25%÷当年天数  
H为每日应计提的销售服务费  
E为前一日的基金资产净值  
基金管理人应于每月月末,按上月末计提费用,由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、公休等,支付日期顺延。

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 58,633.38    |
| 2  | 应收证券清算款 | 53,872.83    |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,832,064.52 |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 其他流动资产  | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他资产    | -            |
| 9  | 合计      | 3,944,570.73 |

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 113008 | 电可转债 | 2,623,000.00 | 2.29         |

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。  
6. 报告期末前十名资产支持证券投资明细  
截至本报告期末本基金持有中小企业私募债券公允价值5,022,904.11元,明细如下:  
债券名称 债券代码 债券名称 数量(张) 期末公允价值  
125400 14南农14 950 50,000 5,022,904.11

**十三、基金业绩**  
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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金过往业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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) 截至6个月基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益差别的比较:

| 阶段                    | 净值增长率  | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准标准差 | ①-③    | ②-④   |
|-----------------------|--------|----------|--------|-----------|--------|-------|
| 2013/05/16-2013/12/31 | -4.90% | 0.36%    | 1.76%  | 0.01%     | -6.66% | 0.29% |
| 2014/01/01-2014/12/31 | 10.62% | 0.16%    | 2.81%  | 0.01%     | 7.81%  | 0.15% |
| 2015/01/01-2015/09/30 | 6.18%  | 0.53%    | 1.59%  | 0.01%     | 4.59%  | 0.52% |
| 2013/05/16-2015/09/30 | 11.70% | 0.35%    | 6.30%  | 0.01%     | 5.40%  | 0.34% |

截至6个月C类基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益差别的比较:

| 阶段                    | 净值增长率  | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准 | 业绩比较基准标准差 | ①-③    | ②-④   |
|-----------------------|--------|----------|--------|-----------|--------|-------|
| 2013/05/16-2013/12/31 | -5.10% | 0.36%    | 1.76%  | 0.01%     | -6.86% | 0.29% |
| 2014/01/01-2014/12/31 | 10.43% | 0.15%    | 2.81%  | 0.01%     | 7.62%  | 0.14% |
| 2015/01/01-2015/09/30 | 6.01%  | 0.53%    | 1.59%  | 0.01%     | 4.43%  | 0.52% |
| 2013/05/16-2015/09/30 | 11.11% | 0.35%    | 6.30%  | 0.01%     | 4.80%  | 0.34% |

(二) 截至6个月A类基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益差别的比较

## 证券简称:柘中股份 证券代码:002346 公告编号:2015-66 上海柘中集团股份有限公司 第二届董事会第三十七次会议决议公告

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。  
上海柘中集团股份有限公司第二届董事会第三十七次会议于2015年12月15日以传真、电话等方式通知全体董事,本次会议于2015年12月25日上午10:00在公司会议室举行,董事长阮国生主持了会议。公司应到董事九名,实到董事九名,本次会议已召开程序符合《公司法》、公司章程等有关法律规定。  
会议审议通过了以下决议:  
一、票赞成0票反对0票弃权0票回避 审议通过 关于子公司向上海蕴椿投资管理有限公司增资扩股的议案;  
为进一步提升公司“大投资业务”的发展计划,为公司创造新的利润来源,提升公司盈利能力,公司同意以全资子公司柘中投资使用自有资金向上海蕴椿投资管理有限公司增资18000万元,用于认购上海蕴椿投资管理有限公司新增注册资本中的18000万元,上海蕴椿投资管理有限公司此次增资完成后,公司持股比例为90%。  
该事项不构成关联交易,也不构成重大资产重组,不需要提交股东大会审议。  
特此公告。  
上海柘中集团股份有限公司  
董事会  
二〇一五年十二月二十八日

## 证券简称:柘中股份 证券代码:002346 公告编号:2015-67 上海柘中集团股份有限公司关于全资子公司向上海蕴椿投资管理有限公司增资扩股的公告

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。  
上海柘中集团股份有限公司(以下简称“公司”)第三届董事会第三十七次会议审议通过了 关于子公司向上海蕴椿投资管理有限公司增资扩股的议案,该事项不构成关联交易,也不构成重大资产重组,不需要提交股东大会审议。现将相关内容公告如下:  
**一、对外投资概述**  
公司全资子公司上海柘中投资有限公司(以下简称“柘中投资”)拟以自有资金人民币18,000万元认缴上海蕴椿投资管理有限公司(以下简称“蕴椿投资”)的新增注册资本18,000万元,本次增资后,蕴椿投资的注册资本变更为人民币20,000万元,公司占其增资扩股后注册资本的90%。  
**二、交易对方的基本情况**  
1.赵汉英,蕴椿投资股东,赵汉英先生与公司董事、监事、高级管理人员不存在关联关系。  
2.文汉英,蕴椿投资股东,文汉英女士与公司董事、监事、高级管理人员不存在关联关系。  
**三、交易标的基本情况**  
1.公司基本情况  
公司名称:上海蕴椿投资管理有限公司  
成立时间:2015年10月29日  
住所:上海市青浦区外青松公路7548弄588号1幢1层T区116室  
经营范围:投资管理,实业投资,企业管理咨询,企业管理咨询,会务服务,展览展示服务,市场营销策划,计算机软硬件开发。  
公司类型:有限责任公司(国内合资)  
注册资金:100万元  
2.本次交易后,蕴椿投资的股权结构如下:  

| 序号 | 股东姓名或名称    | 出资额     | 持股比例 |
|----|------------|---------|------|
| 1  | 赵汉英        | 1000万元  | 5%   |
| 2  | 文汉英        | 1000万元  | 5%   |
| 3  | 上海柘中投资有限公司 | 18000万元 | 90%  |

  
3.财务状况  
交易标的公司为2015年10月29日新成立公司,目前尚未有任何经营。  
四、本次增资扩股的目的、存在的风险及对公司的影响  
1.本次公司向投资以蕴椿投资新增注册资本事项系为进一步贯彻公司扩大投资业务的发展计划,为公司创造新的利润来源,提升公司盈利能力,符合公司发展规划。  
2.存在的风险及对公司的影响  
本次交易的标的公司此前尚未开展经营,本次增资后后期经营存在一定不确定性;本次交易后公司目标控股子公司,将会对公司合并报表范围产生影响;本次交易不会对公司现金流造成较大压力,对公司正常的生产经营亦不会产生负面影响。  
五、备查文件  
公司第三届董事会第三十七次会议决议  
特此公告。  
上海柘中集团股份有限公司  
董事会  
二〇一五年十二月二十八日

## 景顺长城