



Disclosure 信息披露

2016年1月16日 星期六
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B68

(上接B67版)

(3)由固定收益分析师根据宏观经济形势和分析报告,采用利率预期策略等对未来利率走势作出判断后,对银行间市场和交易所市场两市场的固定收益证券投资组合进行动态调整;

(4)固定收益证券投资技术配置,由基金固定收益分析员在战略配置基础上,根据整体宏观经济的发展趋势和资本市场未来的行情走势,采用利率免疫化、久期控制等债券投资策略对固定收益证券组合进行战术性配置与调整;

(5)基金经理根据固定收益分析员的研究结论,确定在银行间市场和交易所市场的国债、中央银行票据、金融债、短期融资券、企业(公司)债、可转债、资产支持证券等品种的资产配置计划,构造投资组合方案,并形成具体投资指令后由交易部门实施;(模型测算)

(6)所有投资决策过程均由风险控制与投资管理部门进行同步监控,并对投资结果进行绩效评价,其评价标准均作为重要的反馈信息反馈到投资决策委员会与投资管理部门,以用来对投资策略进行调整,对基金投资组合的风险控制提出建议。

十一、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2015年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

序号		项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资		3,190,334.77	0.04
	其中:股票		1,190,334.77	0.04
2	固定收益投资		2,789,499,363.00	98.74
	其中:债券		2,789,499,363.00	98.74
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:买入返售金融的买入返售金融资产		-	-
6	银行存款和拆借资金支付合计		3,473,909.91	0.12
7	其他资产		36,933,031.44	1.09
合计			2,824,947,268.12	100.00

序号		行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔、渔业	-	-	-
A	畜牧业	-	-	-
B	渔业	-	-	-
C	制造业	-	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	-
E	建筑业	-	-	-
F	批发和零售业	-	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	-
I	金融业	-	-	-
K	房地产业	-	-	-
L	批发和商务服务业	-	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-	-
N	卫生和社会工作	-	-	-
O	教育、培训和继续教育服务业	-	-	-
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			3,190,334.77	0.04

序号		股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000067	中国宝安	316,294.00	815,192.86	0.04
2	000089	深圳机场	54,151.00	344,941.87	0.02

序号		债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	央行票据	6,933,530.00	-	0.32
2	央行票据	-	-	-	-
3	央行票据	-	-	-	-
4	央行票据	-	-	-	-
5	央行票据	-	-	-	-
6	央行票据	-	-	-	-
7	央行票据	-	-	-	-
8	央行票据	-	-	-	-
9	央行票据	-	-	-	-
10	合计			2,789,499,363.00	129.85

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1014022	14北大债MTN801	1,000,000.00	103,700,000.00	4.80
2	1501022	15国开12	1,000,000.00	103,700,000.00	4.69
3	011509516	15国开2C002	600,000.00	59,982,000.00	2.79
4	0115010103	15国开2C003	600,000.00	59,970,000.00	2.79
5	121256	14国债07	890,000.00	86,017,500.00	3.81

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

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

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

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

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

10.3 本期国债期货投资评价

11 投资组合报告附注

11.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体没有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。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他各项资产构成

11.4 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	4,196,800.00	0.20
2	128009	歌尔转债	1,551,360.00	0.07
3	110037	格力转债	364,420.00	0.02

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情况。

十二、基金的业绩

本基金的投资业绩不承诺未来表现。

1. 本报告期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

2. 申万菱信添益宝债券A基金:

阶段	净值增长率①	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
2008年12月10日(基金合同生效日)至2009年12月31日	2.40%	0.12%	-2.80%	0.12%	20%	-0.01%
2010年1月1日至2010年12月31日	13.03%	0.20%	-0.07%	0.10%	14.09%	0.10%
2011年1月1日至2011年12月31日	-9.77%	0.20%	3.82%	0.11%	-9.29%	0.12%
2012年1月1日至2012年12月31日	7.26%	0.15%	-0.67%	0.07%	7.87%	0.08%
2013年1月1日至2013年12月31日	21.44%	0.23%	-5.26%	0.11%	7.42%	0.12%
2014年1月1日至2014年12月31日	17.06%	0.25%	7.48%	0.13%	9.52%	0.10%
2015年1月1日至2015年9月30日	5.26%	0.52%	2.09%	0.12%	3.43%	0.40%
自基金合同生效日至2015年9月30日	47.73%	0.26%	1.98%	0.11%	45.78%	0.15%

申万菱信添益宝债券B基金:

阶段	净值增长率①	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
2008年12月10日(基金合同生效日)至2009年12月31日	2.40%	0.12%	-2.80%	0.12%	4.90%	0.00%
2010年1月1日至2010年12月31日	13.18%	0.20%	-0.07%	0.10%	14.09%	0.10%
2011年1月1日至2011年12月31日	-9.77%	0.20%	3.82%	0.11%	-9.29%	0.12%
2012年1月1日至2012年12月31日	7.26%	0.15%	-0.67%	0.07%	7.87%	0.08%
2013年1月1日至2013年12月31日	21.44%	0.23%	-5.26%	0.11%	7.42%	0.12%
2014年1月1日至2014年12月31日	17.06%	0.25%	7.48%	0.13%	9.52%	0.10%
2015年1月1日至2015年9月30日	5.26%	0.52%	2.09%	0.12%	3.21%	0.40%
自基金合同生效日至2015年9月30日	45.38%	0.26%	1.98%	0.11%	43.38%	0.15%

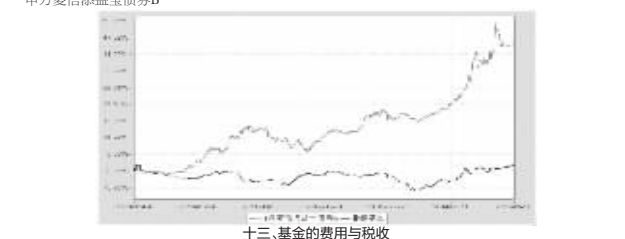
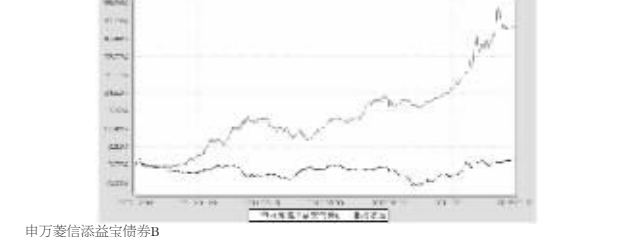
2 自基金合同生效后以类基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信添益宝债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年12月14日至2015年9月30日)

申万菱信添益宝债券A



申万菱信添益宝债券B

十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1. 与基金运作有关的费用的种类:

(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) 基金销售服务费;

(5) 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所和律师费;

(6) 基金的证券交易费用;

(7) 基金的银行汇划费用;

(8) 销售服务费:本基金从B类基金份额的基金资产中计提销售服务费;

(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。

2. 基金终止清算时发生费用,按实际支出金额从基金资产中扣除。

3. 基金管理人管理基金资产,计提标准和支付方式

基金管理费按前一日基金资产净值的0.46%费率计提,计算方法如下:

$H = E \times 0.46\%$ 当日天数

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,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2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

4. 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.26%费率计提,计算方法如下:

$H = E \times 0.26\%$ 当日天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,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2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

证券代码:000057 证券简称:珠海港 公告编号:2016-003
债券代码:112025 债券简称:11珠海债

珠海港股份有限公司 关于“11珠海债”票面利率调整 及投资者回售实施办法的第二次提示性公告

本公司及董事局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、根据珠海港股份有限公司(简称“公司”、“本公司”或“发行人”)于2011年2月25日公告的《珠海港股份有限公司公开发行公司债券募集说明书》,本期债券(债券代码:112025,简称“11珠海债”)债券持有人有权在债券存续期间第5年末将其持有的债券按面值全部或部分回售给发行人。

2、根据《珠海港股份有限公司公开发行公司债券募集说明书》,公司作为“11珠海债”的发行人,有权在本次公司债券存续期间第5年末选择是否上调本期公司债券存续后本期期的票面利率。本期债券在存续期间前5年票面利率为6.80%,在债券存续期间前5年固定不变;在本期公司债券存续期间的第5年末,发行人选择不上调票面利率,即本期债券存续期后3年的票面利率仍为6.80%,并在债券存续期内后3年固定不变。

3、投资者参与回售等同于以人民币100元/张(不含利息)卖出持有的“11珠海债”,截至本公告发出前最后一个交易日(2016年1月15日)，“11珠海债”的收盘价为103.74元/张,高于回售价格。因此投资者选择回售可能会带来损失,敬请投资者注意风险。

4、投资者回售选择权,可选择不回售,部分回售或全部回售。

5、回售申报期:2016年1月1日至1月22日,共十个工作日。

6、回售资金到账日:2016年3月1日。

现将发行人关于调整“11珠海债”票面利率和投资者回售实施办法相关事宜公告如下:

一、“11珠海债”基本情况及利率调整事项

1、债券名称:2011年珠海港股份有限公司公司债券

2、债券简称:11珠海债

3、债券代码:112025

4、发行总额:人民币5亿元

5、债券期限:8年期,在第5年末附发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权。

6、债券利率:票面利率6.80%

7、债券形式:实名制记账式公司债券

8、还本付息方式:本期债券按年付息,到期一次还本,利息每年支付一次,最后一期利息随本金一起支付

9、起息日:债券存续期间每年的3月1日为该计息年度起息日

10、付息日:本期债券存续期间,自2012年起每年的3月1日(如遇法定节假日或休息日,则顺延至其后的第一个工作日)为上一计息年度的付息日

11、担保情况:本期债券由珠海港控股集团有限公司提供无条件的不可撤销的连带责任保证担保,担保范围包括本期债券的本金及利息、违约金、损害赔偿金、实现债权的费用及其他应支付的费用

12、信用评级:经中诚信证券评估有限公司综合评定,发行人的主体信用等级为AA+,本期债券信用等级为AA

13、上市时间和地点:本期债券于2011年3月25日在深圳证券交易所上市交易

14、登记、托管、委托债券派息、兑付机构:在深圳证券交易所深圳分公司(以下简称“中国结算深圳分公司”)

15、本次利率调整:在“11珠海债”存续期间的第5年末,发行人选择不上调票面利率,即本期债券存续期后3年的票面利率仍为6.80%,并在债券存续期内后3年固定不变。

二、“11珠海债”投资者回售选择权及回售实施办法

1、投资者回售选择权:投资者可选择不回售,部分回售或全部回售。

2、投资者参与回售等同于以人民币100元/张(不含利息)卖出持有的“11珠海债”,截至本公告发出前最后一个交易日(2016年1月15日)，“11珠海债”的收盘价为103.74元/张,高于回售价格。因此投资者选择回售可能会带来损失,敬请投资者注意风险。

3、回售申报期:2016年1月1日至1月22日,共十个工作日。

4、回售价格:人民币100元/张(不含利息)。以10张(即面值1,000元)为一个回售单位,回售金额必须是1,000元的整数倍且不少于1,000元。

5、回售登记办法:投资者可选择将持有的债券全部或部分回售给发行人,在回售登记日通过深圳证券登记结算系统系统进行回售申报,当日可以撤单,当日收市后回售申报一经确认,不能撤销,相应的债券将被冻结交易,直至本次回售实施完毕后相应债券被注销。

6、选择回售的投资者须于回售登记日进行登记,逾期未办理回售登记手续即视为投资者不回售,同意继续持有“11珠海债”。

三、回售部分债券付款安排

1、回售资金到账日:2016年3月1日

2、回售部分债券享有2015年3月1日至2016年2月29日期间利息,利率为6.80%。付息每手债券面值1,000元的“11珠海债”派发利息为68元(含税),扣税后个人、证券投资基金债券持有人取得的实际每手派发利息为54.4元;扣税后非居民企业(包含QFII、RQFII)债券持有人取得的实际每手派发利息为61.2元。

3、付款方式:发行人将依照中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的登记结果对

证券代码:600293 股票简称:三峡新材 编号:临2016-006号

湖北三峡新型建材股份有限公司 关于公司第二大股东增持公司股份的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、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法律责任。

2016年1月15日,湖北三峡新型建材股份有限公司(以下简称公司)收到第二大股东海南宗宣达实业投资有限公司(以下简称海南宗宣达)的通知,其已于2016年1月15日通过二级市场增持了公司的股票,具体如下:

一、本次增持情况

海南宗宣达于2016年1月15日通过二级市场增持了公司15100股,增持后,海南宗宣达持有公司4243440股,占公司总股本的12.32%,为公司第二大股东,增持后,海南宗宣达持有公司4249500股,占公司总股本的12.32%,仍为公司第二大股东。

证券代码:000157 证券简称:中联重科 公告编号:2016-001号

中联重科股份有限公司 关于2016年度第一、二期超短期融资券发行情况的公告

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。

中联重科股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年6月29日召开的公司2014年年度股东大会审议通过了《关于拟发行超短期融资券的议案》,公司拟申请注册发行总额不超过人民币50亿元,期限不超过270天的超短期融资券,决议有效期为自股东大会审议通过之日起36个月,详情请见公司于2015年6月6日披露的《2014年度股东大会A、股类别股东大会及H股类别股东大会决议公告》(公告编号:2015-032)。2015年10月19日,公司完成了2015年度第一期超短期融资券发行,发行额为50亿元人民币,期限为60天,发行利率为3.03%,起息日期为2015年10月19日,于2015年12月18日完成兑付,详情请见公司于2015年10月21日披露的《关于2015年度第一期超短期融资券发行情况的公告》(公告编号:2015-051)。

2016年1月14日,公司完成了2016年度第一、二期超短期融资券(以下简称“本次超短期”)的发行,其中:2016年度第一期超短期融资券发行,发行额为25亿元人民币,期限为270天,单位

二、其他说明

1、本次增持目的:海南宗宣达基于对公司未来持续稳定发展的信心,增强广大投资者的信心,决定通过上海证券交易所交易系统增持本公司股票。

2、本次增持行为不会导致公司股权分布不具备上市条件。

3、海南宗宣达承诺在本次增持期间及增持完成后六个月内不减持公司股份。

4、公司将继续按照相关法律法规的规定,真实、准确、及时、完整地履行信息披露义务。

特此公告。

湖北三峡新型建材股份有限公司董事会

2016年1月15日

证券代码:000157 证券简称:中联重科 公告编号:2016-001号

中联重科股份有限公司 关于2016年度第一、二期超短期融资券发行情况的公告

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。

中联重科股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年6月29日召开的公司2014年年度股东大会审议通过了《关于拟发行超短期融资券的议案》,公司拟申请注册发行总额不超过人民币50亿元,期限不超过270天的超短期融资券,决议有效期为自股东大会审议通过之日起36个月,详情请见公司于2015年6月6日披露的《2014年度股东大会A、股类别股东大会及H股类别股东大会决议公告》(公告编号:2015-032)。2015年10月19日,公司完成了2015年度第一期超短期融资券发行,发行额为50亿元人民币,期限为60天,发行利率为3.03%,起息日期为2015年10月19日,于2015年12月18日完成兑付,详情请见公司于2015年10月21日披露的《关于2015年度第一期超短期融资券发行情况的公告》(公告编号:2015-051)。

2016年1月14日,公司完成了2016年度第一、二期超短期融资券(以下简称“本次超短期”)的发行,其中:2016年度第一期超短期融资券发行,发行额为25亿元人民币,期限为270天,单位

二、其他说明

1、本次增持目的:海南宗宣达基于对公司未来持续稳定发展的信心,增强广大投资者的信心,决定通过上海证券交易所交易系统增持本公司股票。

2、本次增持行为不会导致公司股权分布不具备上市条件。

3、海南宗宣达承诺在本次增持期间及增持完成后六个月内不减持公司股份。

4、公司将继续按照相关法律法规的规定,真实、准确、及时、完整地履行信息披露义务。

特此公告。

湖北三峡新型建材股份有限公司董事会

2016年1月15日

证券代码:000157 证券简称:中联重科 公告编号:2016-001号

二〇一六年一月十六日

证券代码:002719 证券简称:麦趣尔 公告编号:2016-001

麦趣尔集团股份有限公司 关于使用暂时闲置自有资金购买理财产品进展情况的公告

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

麦趣尔集团股份有限公司(以下简称“公司”)于2015年5月26日年度股东大会审议通过了《关于使用部分闲置募集资金及暂时闲置自有资金购买理财产品的议案》,同意使用暂时闲置自有资金不超过2亿元、暂时闲置募集资金不超过3亿元,用于购买短期(投资期限不超过一年)低风险保本型银行理财产品,该额度可滚动使用,在单笔金额并且总额度不超过上述范围内,授权公司管理层负责办理相关事宜,自此额度经股东大会审议通过之日起一年内有效。(详见2015年4月17日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》及巨潮资讯网的《麦趣尔:关于使用部分闲置募集资金及暂时闲置自有资金购买理财产品之更正的公告》)。

公司于2016年1月14日与乌鲁木齐商业银行人民支行签订了“金鑫玉人民币对公理财产品2016年第1期协议书,约定公司以人民币4,000万元暂时闲置自有资金购买该理财产品。

具体事项公告如下:

一、理财产品主要内容

(一)产品名称:金鑫玉人民币对公理财产品2016年1期(A16001)

(二)发行人:乌鲁木齐商业银行总行支行;

(三)币种:人民币;

(四)产品类型:保本浮动收益理财产品;

(五)产品预期年收益率:3.2%;

(六)期限:70天;

(七)产品起始日:2016年1月15日;

(八)产品到期日:2016年3月25日;

(九)收益支付方式:在理财产品到期日,一次性把理财收益划转至账户;

(十)购买理财产品金额:肆仟万元整(RMB4,000万元);

(十一)资金来源:公司暂时闲置自有资金;

(十二)关联关系说明:公司与商业银行无关联关系;

(十三)产品风险提示