（上接B90版）

客服电话:021-22267995/400-928-2266
公司网址:www.dtfunds.com
（49）深圳富济财富管理有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:?陈勇军
联系电话:0755-83999907-806
传真:0755-83999926
客服电话:0755-83999913
公司网址:www.jinqianwo.cn
(50)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
联系人:李晓明
联系电话:021-63333319
传真:021-63332523
客服电话:4000178000
公司网址:www.lingxianfund.com
(51)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏嫦
联系电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网址:www.yingmi.cn
(52)上海联泰资产管理有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路?518?号?8?座?3?层
法定代表人:燕斌
联系人:?陈东
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.66zichan.com
(53)奕丰金融服务（深圳）有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115、1116、1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
联系电话:0755-8946 0507
传真:0755 2167 4453
客服电话:4006846500/4006840500
公司网址:www.ifastps.com.cn
（54）北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人:赵荣春
联系人:盛海娟?
联系电话:010-57418813?
客服电话:400-893-6885
公司网址: www.qianjing.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求,增加其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
（二）登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人:黄鹏
总经理:黄鹏
成立日期:2004年3月18日
电话:021-38429808
传真:021-68419328
联系人:周琳
（三）担保人
名称:中国投融资担保股份有限公司
住所:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9?层
办公地址:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9?层
法定代表人:黄炎勋
成立日期:1993年12月4日
组织形式:股份有限公司
注册资本:4,500,000,000元人民币
经营范围:融资性担保业务:贷款担保、票据承兑担保、贸易融资担保、项目融资担保、信用证担保及其他融资性担保业务。监管部门批准的其他业务:债券担保、诉讼保全担保、投标担保、预付款担保、工程履约担保、尾付款如约偿付担保等履约担保业务,与担保业务有关的融资咨询、财务顾问等中介服务,以自有资金投资。投资及投资相关的策划、咨询;资产受托管理;经济信息咨询;人员培训;新技术、新产品的开发、生产和产品销售;仓储服务;组织、主办会议及交流活动。上述范围涉及国家专项规定管理的按有关规定办理。
（四）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:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人:韩炯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿
（五）审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:杨绍信
联系电话:（021）23238888
传真:（021）23238800
联系人:赵钰
经办会计师:薛竞、赵钰

四、基金的名称

中海惠祥分级债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、惠祥B份额的保本

（一）保本

在第一个保本周期到期日，如惠祥B份额持有人认购并持有到期的惠祥B份额与到期日惠祥B份额净值的乘积低于其认购保本金额，则基金管理人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。基金托管人对于保本赔付差额的计算及支付不承担复核义务。

本基金第一个保本周期后各保本周期到期日,如惠祥B份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的惠祥B份额的可赎回金额低于其过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额，则基金管理人或保本义务人应补足该差额。

惠祥B份额持有人在保本周期内申购，或在当期保本周期到期日前赎回或转换转出的惠祥B份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应惠祥B份额不适用本条款。

认购保本金额为惠祥B份额持有人认购并持有到期的惠祥B份额的投资金额，即惠祥B份额持有人认购并持有到期的惠祥B份额净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。

过渡期申购保本金额为惠祥B份额持有人过渡期申购并持有到期的惠祥B份额的投资金额，即惠祥B份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的惠祥B份额在过渡期截止日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和。

从上一保本周期转入当期保本周期的惠祥B份额的保本金额为惠祥B份额持有人从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的惠祥B份额的投资金额，即惠祥B份额持有人将其上一保本周期持有到期的惠祥B份额转入当期保本周期并持有到期的，其惠祥B份额在过渡期截止日所代表的资产净值。

对于基金份额持有人多次认购或申购、赎回的情况，以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

若惠祥B份额获得保本赔付差额，将不再对惠祥A份额未获得的约定收益部分进行补足。

保本周期届满后，若本基金惠祥B份额不符合保本基金存续条件的，则惠祥B份额不再设置保本保障机制。

（二）保本周期

本基金惠祥B份额的保本周期每2年为一个周期，保本周期与分级运作周期为同一期间。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期起始日。基金合同中若无特别所指，保本周期即为惠祥B份额的当期保本周期。

本基金第一个保本周期后的各保本周期自基金管理人公告的保本周期起始日起至2个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日或该公历年不存在对应日的，则保本周期到期日为该日前的最后一个工作日。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始时间。

（三）保本案例

若某投资者投资10,000 元认购本基金惠祥B份额（该认购申请被全额确认）并持有到保本周期到期，认购费率为0.6%。假定募集期间产生的利息为3元，则：

净认购金额=10,000/（1+0.6%）=9,940.36元
认购费用=10,000-9,940.36=59.64元
认购份额=（9,940.36+3）/1.00=9,943.36份
1、若保本周期到期日，惠祥B份额净值为0.90元。
认购保本金额=9,940.36+59.64+3=10,003.00元
可赎回金额=0.90×9,943.36=8,949.02元
即：可赎回金额＜认购保本金额
保本赔付差额=10,003.00-8,949.02=1053.98元
若保本周期到期日该投资者赎回惠祥B份额，则基金管理人将按照认购保本金额向该投资者支付10,003.00元。
2、若保本周期到期日，惠祥B份额资产净值为1.20元。
认购保本金额=9,940.36+59.64+3=10,003.00元
可赎回金额=1.20×9,943.36=11,932.03元
即：可赎回金额＞认购保本金额
若保本周期到期日该投资者赎回惠祥B份额，则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付11,932.03元。

（四）适用保本条款的基金份额

1、对于本基金第一个保本周期而言，惠祥B份额持有人认购并持有到期的惠祥B份额。

2、对于本基金第一个保本周期后的保本周期而言，惠祥B份额持有人在本基金过渡期内申购并持有到期的惠祥B份额、惠祥B份额持有人从本基金上一个保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期的惠祥B份额。

（五）不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日，按惠祥B份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的惠祥B份额与到期日惠祥B份额净值的乘积不低于其认购保本金额、或过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的惠祥B份额的保本金额；

2、惠祥B份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的惠祥B份额；

3、惠祥B份额持有人在保本周期内申购或转换转入本基金的惠祥B份额；

4、在惠祥B份额保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

5、在惠祥B份额保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

6、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人或保本义务人免于履行保本义务的；

7、若惠祥B份额持有人从本基金上一个保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期的基金份额所代表的资产净值总额超过担保人提供的当期保本周期担保额度或保本义务人提供的当期保本周期保本额度的，基金管理人按照约定确认的可享受保本条款的基金份额之外的其他部分基金份额。

8、未经担保人书面同意而修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行的修改除外。

9、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任。

七、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、地方政府债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具，股票、权证等权益类资产，以及经法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的配置比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%，基金持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

本基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

九、基金的投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。

本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融工具的收益及风险特征，动态确定基金资产在固定收益类资产和权益类资产的配置比例。

2、固定收益品种的投资策略

（1）固定收益品种的配置策略

1）久期配置

久期配置策略是对组合进行合理的久期控制，以实现对利率风险的有效管理。本基金基于对宏观经济指标和宏观经济政策的分析，判断宏观经济所处的经济周期，由此预测利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征；同时结合债券市场资金供求分析，最终确定投资组合的久期配置。

2）期限结构配置

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用统计和数量分析技术，对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的收益进行分析，在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

子弹组合，即，使组合的现金流尽量集中分布；

杠铃组合，即，使组合的现金流尽量呈两极分布；

梯形组合，即，使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

3）债券类别配置

在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上，本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾其基本面分析，综合分析各品种的利差和变化趋势。在信用利差水平较高时持有公司债（企业债）、中小企业私募债、资产支持证券等信用品种，在信用利差水平较低时持有国债、央行票据等利率品种，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

（2）个券的投资策略（可转换债券除外）

个券的选择应遵循如下原则：

相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低的品种。

流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。

1）利率品种的投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在久期配置策略与期限结构配置策略基础上，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，通过采取利差套利策略、相对价值策略等决定投资品种。

2）信用品种的投资策略（中小企业私募债除外）

本基金对企业债、公司债和资产支持证券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用品种的信用风险、流动性风险、市场风险等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业和公司基本面研究方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

本基金将借助公司内部的行业及公司研究员的专业研究能力，并综合参考外部研究机构的研究成果，对发债主体企业进行深入的基本面分析，主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、公司治理、股东或地方政府的实力以及支持力度等；并结合债券的发行条款，综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上以确定信用品种的实际信用风险状况及其信用利差水平，投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。

3）中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略，在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

（3）可转换债券投资策略

可转换债券兼具债券和股票的相关特性，其投资风险和收益介于债券和股票之间。在进行可转换债券筛选时，本基金将首先对可转换债券自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估；最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。

（4）其它交易策略

1）杠杆放大策略：即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

2）公司债跨市场套利：公司债将在银行间市场和交易所市场同时挂牌，根据以往的经验，两个市场的品种将出现差价套利交易的机会。本基金将利用两个市场相同公司债券交易价格的差异，锁定其中的收益进行跨市场套利，增加基金资产收益。

3、股票投资策略

本基金股票投资主要采用定量与定性的方式精选股票。定量方式主要通过各指标分析判断企业未来的分红能力及意愿，从而精选出现金股息率高、分红潜力强的优质上市公司；定性方式主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的核心竞争优势，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。

十、基金的投资决策依据和决策程序

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和基金合同的规定；

（2）国家宏观经济环境及其对债券市场、证券市场的影响；

（3）国家货币政策、财政政策以及债券市场政策；

（4）货币市场、债券市场资金供求状况及未来走势。

2、投资决策程序

为明确投资各环节的业务职责，防范投资风险，基金管理人建立规范的投资流程。

（1）投资决策委员会定期召开会议确定股票/债券资产投资比例，形成基金投资的投资决议。

（2）研究部和金融工程部提出个券、个股选择、数量化投资建议，为基金经理和投资决策委员会提供投资参考依据。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，结合研究部和金融工程部提出的建议，构建投资组合。

（4）交易部依据基金经理的指令，执行交易，交易进行过程中，交易员及时反馈市场信息。

（5）风险管理部对基金投资组合的风险进行跟踪、评估、控制，对投资组合的绩效进行分析。

十一、基金的投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，权益类资产占基金资产的比例不超过20%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

（3）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的10%；

（4）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%。债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（5）本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（6）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的5‰；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

（8）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（9）本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

（10）本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（11）基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的10%；

（12）本基金持有的全部流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（13）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（14）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，强调基金资产的稳定增值，为此，本基金选取中证全债指数作为本基金的业绩比较基准。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十三、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较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金经过基金份额分级后，惠祥A份额为较低预期风险、收益相对稳定的基金份额；惠祥B份额为中等预期风险、中等预期收益的基金份额。若在分级运作周期内惠祥B份额设置保本保障机制的，则惠祥B份额为较低预期风险、中等预期收益的基金份额。

十四、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定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为截至2015年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

截至2015年12月31日，中海惠祥分级债券型证券投资基金资产净值为877,137,075.58元，基金份额净值为1.057元，累计基金份额净值为1.074元。其资产组合情况如下：

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	887,725,206.10	97.42
	其中：债券	877,725,206.10	96.33
	资产支持证券	10,000,000.00	1.10
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	2,902,592.28	0.32
7	其他资产	20,578,903.20	2.26
8	合计	911,206,701.58	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	-	-
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	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	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	49,093,908.90	5.60
	其中：政策性金融债	49,093,908.90	5.60
4	企业债券	654,106,091.00	74.57
5	企业短期融资券	30,027,000.00	3.42
6	中期票据	105,775,000.00	12.06
7	可转债	38,723,206.20	4.41
8	其他	-	-
9	合计	-	-

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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	101459024	14桐乡城建MTN001	500,000	55,340,000.00	6.31
2	124987	14昆经开	500,000	52,605,000.00	6.00
3	124974	14泸纳债	499,990	52,288,954.20	5.96
4	1182189	11北营钢MTN1	500,000	50,435,000.00	5.75
5	122310	13苏新城	427,020	49,107,300.00	5.60

6、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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	061505001	15沪公积金1A1	100,000	10,000,000.00	1.14

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名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

（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合约。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、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

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

（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合约。

（3）本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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。

（2）报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）截至2015年12月31日，本基金的其他资产项目构成如下：

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	59,117.94
2	应收证券清算款	999,619.28
3	应收股利	-
4	应收利息	19,520,165.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,578,903.20

（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	110031	航信转债	9,757,476.00	1.11
2	113008	电气转债	6,608,160.00	0.75
3	128009	歌尔转债	4,495,040.00	0.51

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金为债券基金，不进行股票投资。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

十五、基金的业绩

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。

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（截止日期2015年12月31日）：

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	2015 ③	②-④
2014.8.29-2014.12.31	2.50%	0.09%	4.24%	0.13%	-1.74%	-0.04%
2015.1.1-2015.12.31	4.82%	0.38%	8.74%	0.08%	-3.92%	0.30%
自基金成立以来至今	7.44%	0.33%	13.35%	0.10%	-5.91%	0.23%

注：本基金合同生效日为2014年8月29日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十六、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、基金销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

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、基金的相关账户的开户及维护费用；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.75%÷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，由基金管理人和基金托管人双方核对后，基金托管人于次月前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0.20%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，由基金管理人和基金托管人双方核对后，基金托管人于次月前3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。

3、基金销售服务费

基金合同生效后，惠祥A份额的销售服务费年费率为0.35%，惠祥B份额不收取销售服务费。

惠祥A份额销售服务费按前一日惠祥A份额基金资产净值的0.35%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.35%÷当年天数

H为惠祥A份额每日应计提的销售服务费

E为惠祥A份额前一日的基金份额（参考）净值与惠祥A份额数的乘积

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人和基金托管人双方核对后，基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给基金销售机构。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4－9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。

过渡期内本基金不计提管理费、托管费和销售服务费。

（三）不列入基金费用的项目

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。

十七、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“基金管理人”部分进行了更新。

（二）对“基金托管人”部分进行了更新。

（三）对“相关服务机构”部分进行了更新。

（四）在“基金的投资”部分，对“基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。

（五）对“基金的业绩”部分按最新资料进行了更新。

（六）在“其他应披露的事项”，披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司
二〇一六年四月十三日

安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期：2016年4月13日

1 公告基本信息

基金名称	安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	安信新常态股票
基金主代码	001583
基金管理人名称	安信基金管理有限责任公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》等
基金经理变更类型	增聘基金经理
新任基金经理姓名	袁玮
共同管理本基金的其他基金经理姓名	蓝雁书

2 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	袁玮			
任职日期	2016-04-11			
证券从业年限	6			
证券投资管理从业年限	6			
过往从业经历	历任安信基金管理有限责任公司研究部研究员、基金投资部基金经理助理。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部基金经理。			
其中：管理过公募基金的名称及期间	基金主代码	基金名称	任职日期	离任日期
是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否			
是否已取得基金从业资格	是			
取得的其他相关从业资格	-			
国籍	中国			
学历、学位	博士研究生、理学博士			
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是			

3 其他需要说明的事项

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会办理变更手续，并报中国证券监督管理委员会深圳证券监管局备案。

特此公告。

安信基金管理有限责任公司
2016年4月13日

证券代码：601566　　证券简称：九牧王　　公告编号：临2016-003

九牧王股份有限公司关于2015年度利润分配事项征求意见的公告

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。

根据中国证券监督管理委员会《上市公司监管指引第3号--上市公司分红》及上海证券交易所《上市公司现金分红指引》的相关规定，为做好九牧王股份有限公司（以下简称"公司"）2015年度利润分配工作，增强公司利润分配透明度，保护广大股东及投资者尤其是中小股东及投资者的利益，现就公司2015年度利润分配相关事项向广大股东及投资者征求意见。

本次征求意见于2016年4月13日9:00起至2016年4月19日下午5:00止，股东及投资者可通过以下方式将书面意见反馈至公司：

电子邮箱：ir@joeone.net

传真：0592-2955997

为便于投资者意见的收集与保存，请在书面意见中注明"关于九牧王股份有限公司2015年度利润分配事项的建议"字样，并注明"投资者姓名/全称、身份证号码/组织机构代码、股东账户卡号"等信息。

特此公告。

九牧王股份有限公司
董事会
二〇一六年四月十二日

证券代码：002542　　证券简称：中化岩土　　公告编号：2016-31

中化岩土工程股份有限公司关于重大资产重组事项的进展公告

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。

中化岩土工程股份有限公司（以下简称"公司"）因筹划重大事项，经向深圳证券交易所（以下简称"深交所"）申请，公司股票（股票代码：002542，股票简称：中化岩土）自2015年12月28日开市起停牌，2015年12月28日、2016年1月5日分别发布《重大事项停牌公告》（公告编号：2015-86）、《重大事项继续停牌公告》（公告编号：2016-1），2016年1月12日发布《关于筹划重大资产重组的停牌公告》（公告编号：2016-2），2016年1月26日发布《关于重大资产重组进展暨延期复牌公告》，公司股票自2016年1月27日起继续停牌。于2016年2月2日、2月16日、2月23日、3月1日、3月15日、3月22日、3月29日、4月6日披露了《关于重大资产重组事项的进展公告》，3月8日披露了《关于继续筹划重大资产重组暨公司股票延期复牌的公告》，经公司第二届董事会第四十五次临时会议和2016年第一次临时股东大会公司审议通过，股票最晚于2016年5月25日开市时起复牌。

截至本公告日，公司与相关各方及聘请的独立财务顾问、法律顾问及审计、评估等中介机构积极推进本次重组工作，进行尽职调查、审计、评估及相关预案或报告书等文件的编制工作。待上述工作完成后，公司将召开董事会会议，审议本次重大资产重组有关议案并进行披露。

根据《上市公司重大资产重组管理办法》及深圳证券交易所《中小企业板信息披露业务备忘录》的有关规定，公司股票将在董事会审议通过并公告重大资产重组预案或报告书前继续停牌，停牌期间，公司至少每五个交易日发布一次进展公告。

本次重大资产重组事项仍存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

中化岩土工程股份有限公司
董事会
2016年4月12日

方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦金小宝货币市场证券投资基金暂停大额申购业务的公告

公告送出日期：2016年04月13日

1.公告基本信息

基金名称	方正富邦金小宝货币市场证券投资基金	
基金简称	方正富邦金小宝货币	
基金主代码	000797	
基金管理人名称	方正富邦基金管理有限公司	
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《方正富邦金小宝货币市场证券投资基金合同》、《方正富邦金小宝货币市场证券投资基金招募说明书》等。	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停大额申购起始日	2016年04月15日
	暂停大额转换转入起始日	2016年04月15日
	限制申购金额（单位：元）	300,000,000.00
	限制转换转入金额（单位：元）	300,000,000.00
	暂停（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）的原因说明	为了保证基金的平稳运作，保护基金份额持有人的利益。

2.其他需要提示的事项

自2016年04月15日起暂停接受单个基金账户对本基金日累计金额超过3亿元（不含3亿元）的申购业务申请。如单日单个基金账户累计申购或单笔申购本基金金额合计超过3亿元，申购超过3亿元（不含3亿）金额以上的部分本基金注册登记人将有权确认失败。

在暂停本基金的大额申购期间，本基金的赎回等业务正常办理。

关于恢复本基金大额申购业务的时间，基金管理人将另行公告。

如有疑问，请拨打本公司客户服务电话400-818-0990或登录本公司网站www.founderff.com获取相关信息。

特此公告

方正富邦基金管理有限公司
2016年04月13日

证券代码：002296　　证券简称：辉煌科技　　公告编号：2016-026

河南辉煌科技股份有限公司关于第一期员工持股计划实施进展的公告

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。

河南辉煌科技股份有限公司（以下简称"公司"）于2015年12月28日召开第五届董事会第十五次会议、于2016年1月13日召开2016年第一次临时股东大会，审议通过了《关于公司<第一期员工持股计划（草案）>及摘要的议案》，详见公司2015年12月29日、2016年1月14日刊登于《证券时报》、《中国证券报》及巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）的相关公告。

根据中国证监会《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》及深圳证券交易所《中小板信息披露业务备忘录第7号：员工持股计划》的相关要求，现将公司第一期员工持股计划的实施进展情况公告如下：

截至2016年4月12日，公司第一期员工持股计划认购的"红塔资产辉煌1号特定多个客户资产管理计划"通过深圳证券交易所交易系统累计买入公司股票4,807,322股，平均成交价13.50元/股，成交金额为64,912,644.83元（含交易相关费用），买入股票数量占公司总股本的1.28%。

公司将持续关注公司第一期员工持股计划的实施进展情况，并按照相关法律法规的规定及时履行信息披露义务。

特此公告。

河南辉煌科技股份有限公司
董 事 会
2016年4月13日

证券代码：600543　　证券简称：莫高股份　　公告编号：临2016-07

甘肃莫高实业发展股份有限公司关于更换职工代表监事的公告

本公司监事会及全体监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。

2016年4月11日，本公司监事会收到公司职工代表监事朱晓宇先生的辞职报告，朱晓宇先生由于工作原因，辞去公司职工代表监事职务。

根据《公司法》、《公司章程》的有关规定，本公司于 2016 年4月12日在公司会议室召开了职工代表会议，补选严爱民女士（简历附后）为公司第七届监事会职工代表监事，任期至第七届监事会届满。

特此公告。

甘肃莫高实业发展股份有限公司
监 事 会
二〇一六年四月十三日

附：

甘肃莫高实业发展股份有限公司

职工代表监事简历

严爱民，女，汉族，现年48岁，中共党员，大专学历。曾任本公司人力资源部主管、人力资源部副部长。现任本公司人力资源部部长、办公室副主任。

严爱民女士与公司控股股东、实际控制人及其他持有公司 5%以上股份的股东不存在关联关系，未持有本公司股份，未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，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。

证券代码：002594　　证券简称：比亚迪　　公告编号：2016-016

比亚迪股份有限公司关于商用车中标公示的公告

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。

一、项目中标公示情况

比亚迪股份有限公司(以下简称“公司、本公司”)控股子公司比亚迪汽车工业有限公司近日参与投标 “深圳市东部公共交通有限公司2016年3024辆纯电动公交客车更新解决方案项目”（以下简称“该项目”）。该项目由深圳市东部公共交通有限公司委托深圳联合产权交易所进行公开采购，根据深圳联合产权交易所2016年4月12日于网站http://www.eoechina.com.cn发布的该项目公开采购成交公示显示，比亚迪汽车工业有限公司被确定为第一成交供应商，中标内容如下：

标的	名称	第一成交供应商
1	500辆10.30-10.80米纯电动高速公交客车	比亚迪汽车工业有限公司
2	1424辆10.30-10.80米纯电动公交客车	比亚迪汽车工业有限公司
3	600辆8.01-8.60米纯电动公交客车	比亚迪汽车工业有限公司
4	400辆7.01-7.70米纯电动公交客车	比亚迪汽车工业有限公司
5	100辆6.01-6.80米纯电动公交客车	比亚迪汽车工业有限公司

上述标的金额合计约壹拾捌亿壹仟贰佰肆拾捌万元人民币(￥181,248万元），不含国家和地方政府补贴。

二、中标公示事项对公司的影响

该项目若顺利实施，将对公司的经营业绩产生积极影响。

三、风险提示

该项目尚处于公示期(2016年4月12日至2016年4月14日)，最终能否取得《中标通知书》并签署合同尚存在不确定性。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

比亚迪股份有限公司董事会
2016年4月12日

证券代码：601010　　证券简称：文峰股份　　编号：临2016-001

文峰大世界连锁发展股份有限公司关于股东郑素贞女士股份被轮候冻结相关情况的公告

本公司董事会及全体董事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责任。

文峰大世界连锁发展股份有限公司（以下简称"公司"）于2016年4月12日接到上海证券交易所的通知，公安部门向中国证券登记结算有限公司上海分公司送达了《协助冻结财产通知书》和《协助解除冻结财产通知书》，内容如下：

1、《协助冻结财产通知书》：根据《中华人民共和国刑事诉讼法》第一百四十二条/第一百四十三条之规定，请协助轮候冻结郑素贞持有的文峰股份（证券代码601010 证券类别 无限售流通股）27,500万股。冻结期限为2年，自转为正式冻结之日起计算。本次轮候冻结包括孳息（指通过你公司派发的送股、转增股、现金红利），其效力从登记在先的冻结证券解除冻结且本次轮候冻结部分或全部生效之日起产生。（轮候冻结起始日为2016年4月11日）

2、《协助解除冻结财产通知书》：根据《中华人民共和国刑事诉讼法》第一百四十二条/第一百四十三条之规定，请协助解除对郑素贞持有的文峰股份（证券代码601010 证券类别 无限售流通股）27,500万股的冻结，以及协助解除股份冻结期间通过你公司派发的送股、转增股、现金红利的冻结。（解冻日期为2016年4月12日）

郑素贞持有的文峰股份（证券代码601010 证券类别 无限售流通股）27,500万股及孳息仍处于冻结中。

公司所有信息均以在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站上发布的公告为准。敬请广大投资者关注公司公告并注意投资风险。

特此公告。

文峰大世界连锁发展股份有限公司
2016年4月13日