

关于长城久利保本混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告

公告送出日期:2014年1月17日

1 公告基本信息	
基金名称	长城久利保本混合型证券投资基金
基金简称	长城久利保本
基金代码	000030
基金管理人名称	长城基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《长城久利保本混合型证券投资基金基金合同》、《长城久利保本混合型证券投资基金招募说明书》
暂停相关业务的原因、日期、金额及原因说明	暂停大额申购起始日
	暂停大额转换转入起始日
	限制申购金额(单位:人民币元)
	限制转换转入金额(单位:人民币元)
暂停相关业务的原因、日期、金额及原因说明	暂停大额申购(转换转入,定期定额投资)的原因说明

注:本基金暂停大额定期定额投资起始日为2014年1月17日,限制定期定额投资金额为100,000.00元。

- 其他需要提示的事项
 - 本基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务期间,单日每个基金账户的申购、转换转入和定期定额投资累计金额应不超过10万元;如单日每个基金账户的申购、转换转入和定期定额投资累计金额超过10万元(不含10万元),本基金管理人将不予受理。
 - 本基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的时间将另行公告。
 - 本基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务期间,不超过10万元(含10万元)的申购、转换转入和定期定额投资,以及赎回、转换转出等其他业务仍照常办理。
 - 投资者若有疑问,请通过以下方式咨询详情:长城基金管理有限公司客户服务热线400-8868-666,网站www.ccfund.com.cn。

特此公告

长城基金管理有限公司
2014年1月17日

长城岁岁金理财债券型证券投资基金第一个封闭期赎回及下一开放期申购安排公告

长城岁岁金理财债券型证券投资基金(基金代码:200017,以下简称“本基金”)基金合同已于2013年1月23日正式生效。截至2014年1月23日,本基金的第一个封闭期结束,现将该封闭期当期赎回及下一开放期申购安排公告如下:

本基金基金合同对封闭期和开放期的约定如下:“本基金的封闭期指自《基金合同》生效日(包括该日)起或每一个开放期结束之日的次日(包括该日)起至次年对该日(包括该日)的期间。如次年对该日为非工作日,则该日的下一工作日为该封闭期的最后一日。本基金办理申购、赎回业务的开放期指本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起不超过10个工作日的期间。”

根据上述约定,本基金的第一个封闭期当期赎回日为2014年1月24日至2014年1月30日,下一开放期的申购日为2014年1月24日至2014年2月13日,敬请投资人妥善安排申购赎回事宜。

重要提示:

- 1、本基金为定期开放基金,根据基金合同和招募说明书的规定,本次开放期未赎回的基金份额将自动进入下一封闭期,在本基金的封闭运作期间,基金份额持有人会面临不能赎回基金份额的风险,敬请投资人根据自身情况妥善做好交易安排。
- 2、本基金本次开放期办理申购、赎回的时间为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日的交易时间。投资人在开放期每个开放日交易时间之外提出申购、赎回或转换申请的,将会顺延至下一个开放日受理,其基金份额申购、赎回、转换价格将以下一开放日基金份额申购、赎回、转换的价格。在开放期最后一个开放日交易时间结束之后提出有关申请的(即2014年1月30日交易时间结束之后)提出赎回申请,以及2014年2月13日交易时间结束之后提出的申购申请,基金管理人将不予受理。
- 3、本公告仅对本基金本次开放期的申购、赎回等有关事项予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,请阅读本基金的基金合同、招募说明书,或登录本公司网站(www.ccfund.com.cn)、拨打本公司的客户服务电话400-8868-666进行查询。

特此公告

长城基金管理有限公司
2014年1月17日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12营口债”债券估值方法变更的提示性公告

鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下部分基金所持有的债券“12营口债(代码:122682)”2014年1月16日成交价格严重偏离。为使持有该债券的基金估值更加公平、合理,根据中国证监会2008年9月12日下发的[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》及本公司的估值政策和程序,经和托管人协商,本公司决定于2014年1月16日起对旗下基金持有的债券“12营口债”按估值模型计算的公允价值进行估值。

本公司将综合参考各项相关影响因素并与基金托管人协商,自上述债券当日收盘价能反映其公允价值之日起对其恢复按交易所收盘价进行估值。届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站(<http://www.phfund.com>)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2014年1月17日

鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12渝北飞”债券估值方法变更的提示性公告

鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下部分基金所持有的债券“12渝北飞(代码:124116)”2014年1月16日成交价格严重偏离。为使持有该债券的基金估值更加公平、合理,根据中国证监会2008年9月12日下发的[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》及本公司的估值政策和程序,经和托管人协商,本公司决定于2014年1月16日起对旗下基金持有的债券“12渝北飞”按估值模型计算的公允价值进行估值。

本公司将综合参考各项相关影响因素并与基金托管人协商,自上述债券当日收盘价能反映其公允价值之日起对其恢复按交易所收盘价进行估值。届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

本公司旗下基金将严格按照《企业会计准则》、指导意见、中国证监会相关规定和基金合同中关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值,请广大投资者关注。

投资者可登陆我公司网站(<http://www.phfund.com>)或拨打客户服务电话400-6788-999咨询或查阅相关信息。

特此公告。

鹏华基金管理有限公司
2014年1月17日

国投瑞银基金管理有限公司关于新增开放式基金销售机构的公告

根据国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与宜信普泽投资顾问(北京)有限公司(以下简称“宜信普泽投顾”)签署开放式基金销售代理协议,自2014年1月20日起,宜信普泽投顾将代理本公司旗下开放式基金的销售业务。

一、代理基金	基金代码
国投瑞银融华债券	前端收费121001 后端收费128001
国投瑞银景气行业混合	前端收费121002 后端收费128002
国投瑞银核心企业股票	121003(无后端收费)
国投瑞银创新动力股票	前端收费121005 后端收费128005
国投瑞银稳健增长混合	前端收费121006 后端收费128006
国投瑞银成长优选股票	前端收费121008 后端收费128008
国投瑞银稳定增利债券	121009(无后端收费)
国投瑞银货币	A 级份额121011(无后端收费) B 级份额128011(无后端收费)
国投瑞银优化增强债券	A 级份额(前端收费)121012 B 级份额(后端收费)128012
国投瑞银瑞源保本混合	121010(无后端收费)
国投瑞银纯债债券	A 级份额121013(无后端收费) B 级份额128013(无后端收费)
国投瑞银中高等级债券	A 级份额000069(无后端收费) C 级份额000070(无后端收费)
国投瑞银一年定期开放债券	A 级份额0000237(无后端收费) C 级份额0000238(无后端收费)
国投瑞银策略精选混合	000165(无后端收费)
国投瑞银医疗保健康	000523(无后端收费)

二、国投瑞银医疗保健康行业灵活配置混合型证券投资基金认购期为2014年1月13日至1月29日。目前,宜信普泽投顾仅代理该基金的认购等基金业务,其他申购赎回业务的开通情况,将在该基金开放日常申赎业务公告中明确。

三、对于同时具有前端收费和后端收费业务的基础,宜信普泽投顾仅代理基金前端收费业务,后端收费业务暂未开通。

四、宜信普泽投顾同时开办国投瑞银旗下基金的转换业务,基金转换规则详见本公司网站。开通转换业务的基金包括:国投瑞银融华债券、国投瑞银景气行业混合、国投瑞银核心企业股票、国投瑞银创新动力股票、国投瑞银稳健增长混合、国投瑞银成长优选股票、国投瑞银稳定增利债券、国投瑞银货币、国投瑞银优化增强债券、国投瑞银瑞源保本、国投瑞银纯债债券、国投瑞银中高

等级债券、国投瑞银策略精选混合。

五、宜信普泽投顾同时开办上述基金的定期定额投资业务,具体办理以代销机构的相关业务规定为准。

对于宜信普泽投顾的定期定额投资业务,除国投瑞银货币外每期申购金额不低于人民币100元(含申购手续费),其他基金每期申购金额不低于人民币100元(含申购手续费)。

六、上述基金将同时参加宜信普泽投顾网上交易申购费率优惠活动(适用申购及定期定额申购业务),具体业务内容以宜信普泽投顾相关规定为准。

七、咨询方式

- 1、宜信普泽投顾客服电话:400-6099-500
- 2、宜信普泽投顾网站:www.yixinfund.com
- 3、本公司客服电话:400-880-6668
- 4、本公司网站:www.ubsdcic.com

欢迎广大投资者到宜信普泽投顾各营业网点咨询、办理相关业务。

特此公告。

国投瑞银基金管理有限公司
2014年1月17日

国投瑞银基金管理有限公司关于新增国投瑞银医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告

根据国投瑞银基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)签署的开放式基金销售协议,农业银行自2014年1月20日起代理国投瑞银医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的发售业务。

- 一、本基金认购期为2014年1月13日至2014年1月29日。
- 二、投资者可以通过以下途径咨询:
 - 1、农业银行各营业网点
 - 2、农业银行客服电话:95599
 - 3、农业银行网站: www.abchina.com
 - 4、本公司客服电话:400-880-6668
 - 5、本公司网站:www.ubsdcic.com
- 欢迎广大投资者到农业银行各营业网点咨询以及办理本基金的开户及认购等相关业务。

特此公告。

国投瑞银基金管理有限公司
2014年1月17日

富国基金管理有限公司关于富国全球债券证券投资基金解除境外投资顾问协议的公告

富国全球债券证券投资基金(以下简称“富国全球债基金”)自成立以来,在境外投资顾问蒙特利尔银行资产管理公司(BMO Asset Management Inc.)的支持和帮助下,富国基金管理有限公司(以下简称“富国基金”)了解并熟悉了境外证券市场、交易规则等。

鉴于富国基金已具备独立管理富国全球债基金的能力,经双方协商,富国基金与蒙特利尔银行资产管理公司解除富国全球债基金的《投资顾问协议》达成一致意见,自2014年1月17日起,蒙特利尔银行资产管理公司不再担任富国全球债基金的境外投资顾问。

特此公告。

富国基金管理有限公司
2014年1月17日

关于博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增财富证券有限责任公司为代销机构的公告

根据博时基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与财富证券有限责任公司(以下简称“财富证券”)签署的代理销售服务协议,自2014年1月17日起,本公司将增加财富证券代理博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金代码:050025)的申购、赎回业务,并开通定期定额投资及转换业务。

有关详情请咨询财富证券客户服务专线:0731-84403360,访问财富证券网站:www.cfzq.com;或致电博时一线通:9510568(免长途话费),登录本公司网站www.bosera.com了解有关情况。

博时基金管理有限公司
2014年1月17日

(上接B021版)

注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼
法定代表人:杨小勇
联系人:赵越
联系电话:021-20376892
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海浦东新区256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)51150288
传真:(021)51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海、黎明
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:北京市东安门1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人:唐伟强
联系电话:010-8818 5000
传真电话:010-8818 5111
经办注册会计师:王国雷、黄小熠
联系人:彭成初

四、基金的名称

五、基金的类型

本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的运行趋势,自上而下进行宏观分析,自上而下精选个股,在控制信用风险、利率风险、流动性风险前提下,获取债券的投资收益及价差收益。通过参与一级市场投资,获取新股发行收益,为投资者提供稳定的当期收益及较高的长期投资回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的企业债、股票、权证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,其中股票投资仅限于参与新股认购和可转换债券获得的股票,权证投资仅限于参与可分离转债申购或获得的权证,即本基金不从二级市场购买股票或权证。

本基金通过新股认购申购所认购新股在上市首日择机卖出,所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过10个交易日,通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。

本基金主要投资于具有较高息票率的债券品种,包括国债、企业债、可转债、短期融资券、资产支持证券(含资产收益计划)、可转换债券等,投资比例不低于基金资产的80%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

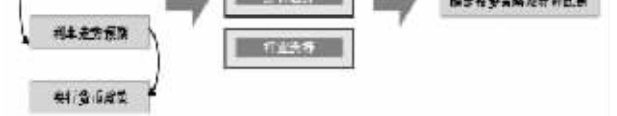
如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场价格运行趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,自上而下决定投资组合久期、期限结构配置及债券类别配置;同时在对企业债进行信用资质研究的基础上,综合考虑企业信用评级(含可转债、企业短期融资券)的信用评级以及包括期限、流动性、信用资质、供求关系、收益率水平等因素,自下而上地配置债券类属和精选个券。通过综合运用骑乘操作、套期操作、新股认购等策略,提高投资组合收益。

(1)资产配置策略
本基金从全球、区域的宏观层面(经济增长、通货膨胀和利率的预期)出发,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场价格运行趋势的基础上,通过深入研究和分析中国国民经济增长、利率和汇率政策的调整、上市公司总体和各个行业的盈利变化趋势,结合定性和定量分析,形成对不同类属资产的预测和判断,确定债券类属资产(含可转债、企业短期融资券)的信用配置比例,把握债券类属资产收益特征的相对变化,动态调整类属资产的投资比例,以规避或控制市场风险,提高资金收益性。

资产配置流程如下:



九、久期管理策略

久期管理策略是债券型基金最基本的投资策略,久期管理策略在本质上是一种自上而下的策略,其目的在于通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

从全球、区域的宏观层面(经济增长、通货膨胀和利率的预期)出发,本基金管理人从宏观经济运行趋势及其引致的财政、货币政策变化做出判断,密切跟踪CPI、PPI、汇率、M2等利率敏感指标,运用数量化工具,对未来市场利率趋势进行分析和预测,并据此确定合理的债券组合久期。

具体而言,基金管理人通过以下三个方面分析来确定实际投资组合债券组合的目标久期:1)宏观经济环境分析:通过对宏观经济数据如月度、季度进出口增长率、消费增长率、投资增长率等的跟踪与分析,预测宏观经济运行趋势,合理预期当前经济周期中所处的阶段;针对当前的经济运行存在的问题,合理预期中央政府的财政与货币政策取向以及当前利率在利率周期中所处的阶段。

2)市场利率变动趋势分析:基于利率周期运行阶段的预期,密切关注月度CPI、PPI等物价指数、准准备金比率、货币供应量、信贷利率等金融运行数据,投资、贸易顺差、工业增加值等实体经济运行数据以及就业数据等央行货币政策所监控的目标数据的变化,预测未来在时间与空间上的变动与趋势,根据法定利率的变化,分析投资者心理与市场供求关系以及流动性等的变化,合理预期市场利率、债券收益率在时间与空间上的可能变动。

3)品种选择策略
综合考虑收益性、流动性和风险性,进行主动性的品种选择,主要包括根据利率预期调整组合久期,选择低估值债券品种进行投资,把握市场上的无风险套利机会,增加盈利性、控制风险等,以争取获得适当的超额收益,提高整体组合收益水平。

(4)金融债(含可转债)投资策略
企业债券投资策略是一种自上而下的利率风险管理方法与自下而上的信用风险管理相结合的策

略,是本基金最主要的投资策略。本基金所指企业债券,包括公司债和企业短期融资券。本基金通过宏观经济运行、企业发展前景、企业偿债能力、建设项目质量等多因素的综合考量对企业债券进行信用评级,并在信用评级的基础上,建立企业债券池;然后基于既定的目标久期、信用评级精选个券进行投资。

具体而言,主要通过以下三个步骤来对企业债券进行投资管理:

1)信用评级分析:建立企业债券的信用评级指标体系,通过综合信用评级确定企业债信用特征。

2)公司基本面分析:投资部对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析,并结合实际调研结果,判定并评价债券的信用程度。

3)筛选企业债券:根据信用评级分析和公司基本面的分析的结果,结合第三方信用评级数据,将高信用评级等级的债券纳入备选债券池,基金经理可直接按流程,按权限从备选债券池中选择债券进行投资。备选债券池外债券,需经投资决策委员会决议方可进行投资。

(5)可转换债券的投资策略
可转换债券兼具股票和债券之间的投资品种,兼具股性和债性的双重特征。一方面,通过

投资部可转换债券对应标的股票的研究,判断正股的价格走势及其与可转换债券之间的联动关系,对目标转债的股性进行合理定价。另一方面,同通过对可转换债券债性的研究,结合可转债债券的发行主体及标的债券进行信用评级,考量其合理定价区间。力求选择被市场低估的品种,构建本基金可转换债券的投资组合。

(6)资产支持证券的投资策略
通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化;通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和风险控制等策略,并针对提前偿还率,并针对提前偿还率,对资产支持证券进行投资管理。将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(7)股票投资策略:
本基金将主动参与股票一级市场投资,但本基金为股票、二级市场之间存在一定的价差是暂时现象,因此,新股认购策略只是一种阶段性投资策略。

本基金将通过分析新股申购一级市场资金面的相关市场风险收益特征的变化,股票发行政策取向(如扩节奏、发行市盈率与二级市场市盈率的差距),预测新股一级市场供求关系的变化,并据此此一下步预测认购新股中签率和新股的收益率变动趋势;同时,借助公司投资平台行业研究员的研究结论,预测拟认购新股的中签率和认购收益率,确定合理规模的资金,精选个股认购,实现新股认购收益的最大化。

本基金通过新股认购认购所认购新股在上市首日择机卖出。

本基金在进行可转换债券投资时,面对可能出现可转换债券与正股之间存在套利机会的现象或者出现可转换债券流动性特征不足的现象,采用可转换债券转股策略,即将持有的可转换债券在转股期内转股操作,以更好的保护本基金投资要素,实现基金可转换债券投资最大化。

本基金通过所持可转换债券转股后的股票持有时间不超过10个交易日。

3)股权投资策略
本基金通过可转债认购所获得的权证,在其上市后持有时间不超过20个交易日。

本基金投资策略主要包括以下几个方面:

本基金将综合考量权证证券的合理内在价值、市场价格、行权价格、行权时间、行权方式、股份历史与预期波动率及无风险收益率要素,运用市场公认的多种期权定价模型等对权证进行定价。

本基金将根据权证的合理内在价值与其市场价格的差额即“估值差价”以及权证合理内在价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理内在价值的估算,决定卖出策略及价格区间。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中信标普全债指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金产品,在开放式基金中,风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币基金和纯债基金。

十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金管理人——交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年10月23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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资组合报告的报告期为2013年7月1日起至9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,576,359.60	81.62
	其中:债券	50,576,359.60	81.62
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	8,000,000.00	12.91
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,233,151.00	1.99
8	其他各项资产	2,154,535.03	3.48
9	合计	61,964,045.63	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

4 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	9,933,000.00	16.42
	其中:政策性金融债	9,933,000.00	16.42
4	企业短期融资券	16,884,665.70	27.91
5	中期票据	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	23,758,693.90	39.28
8	合计	50,576,359.60	83.61

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					
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

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组合
本基金本报告期末未持有资产支持证券

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权证投资组合
本基金本报告期末未持有权证

8 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本期没有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. 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,145.02
2	应收证券清算款	884,846.30
3	应收股利	-
4	应收利息	659,194.72
5	应收申购款	603,348.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,154,535.03

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3	应收股利	-
4	应收利息	659,194.72
5	应收申购款	603,348.99
6	其他应收款	-