

(上接A31版)

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代销基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:汇添富基金管理有限公司

住所:上海市黄浦区桂海路289号金融大厦638室

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路9号震旦国际大楼22楼

法定代表人:林利军

电话:(021)28932888

传真:(021)28932998

联系人:王小姐

(三)律师事务所和经办律师

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

负责人:韩炯

电话:(021)31566666

传真:(021)31565600

经办律师:吕红、黎明

联系人:吕红

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼16层

办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

邮政编码:100738

公司电话:(010)58153000

公司传真:(010)58192929

签章会计师:徐徐、汤骏

业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富实业债券型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

在严格管理风险和保持资产流动性的基础上,努力实现资产的长期稳健增值。

七、基金的投资策略

本基金的投资范围为固定收益类金融工具,包括国债、金融债、央行票据、票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、回购协议、银行存款(包括定期存款及同业存放)、公司债券、货币市场基金等。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可参与一级市场新股申购。因持有可转换债券所获得的股票,因股票的派息或红利而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。

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

本基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的90%,其中对企业的投资比例不低于企业类资产的90%;实业债券(含企业债、金融债)、可转换债券、资产支持证券、回购协议、银行存款(包括定期存款及同业存放)、公司债券、货币市场基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况与金融市场运行趋势,自上而下地决定类固定资产配置组合久期,并依据内部信用评级系统,重点从表面上的深入挖掘低估值的行业债权的品种。本基金采取的投策策略主要包括类属资产配置策略、普通债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。

1.类属资产配置策略

不同类型的债券,由于受到不同的因素影响,在收益率变化及利率变化上表现出明显的不同。本基金将分析各种债券的利差变化趋势,综合分析收益率水平、利率变动幅度、市场偏好及流动性等因素,合理配置并动态调整不同类型债券的投资比例。

2.普通债券投资策略

本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构,结合对政策、货币政策等宏观经济政策的判断,从而预测出金融市场资金供求变动趋势。在此基础上,结合期限利差与久期利差,在不同期限内进行动态调整,制定出合适的利率策略。

3.中小企业私募债券投资策略

本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况与金融市场运行趋势,自上而下地决定类固定资产配置组合久期,并依据内部信用评级系统,重点从表面上的深入挖掘低估值的行业债权的品种。本基金采取的投策策略主要包括类属资产配置策略、普通债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。

(一)投资策略

本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况与金融市场运行趋势,自上而下地决定类固定资产配置组合久期,并依据内部信

用评级系统,内部信用评级遵循从“行业风险”-“公司风险”(包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况,及企业财务状况) -“外部支持”(外部流动性支持能力、及券种担保增信) -“得到评分”的评级过程。

1.定性分析主要是对企业财务数据的基本分析,主要包含四个方面:盈利能力分析、偿债能力分析、现金流和盈利能力分析,盈利能力分析是其对定量分析的重点补充,能够有效提高定量分析的准确性。

2.定量分析主要是对信用风险进行评估,本基金重点关注,公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪,发掘相对价值被低估的债券,以便及时有效地抓住信用债本身使用的机会。

3.券选择策略

本基金将根据信用债市场的收益率水平,在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票贴现、提前偿还和赎回等因素的基础上,建立收益率曲线拟合模型和信用利差曲线拟合模型,并通过这些模型进行估值,重点选取具备以下特征的信用债:较低的收益率,较高当期收入、预期信用质量将改善,以及价值尚未充分反映的信用机会。

4.可转换债券投资策略

对于行业分析,企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境等情况,本基金在二级市场投资可转换债券,以达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产净值的增加。

5.其他投资策略

本基金将根据宏观经济、经济周期,以及阶段性投资主题的把握,综合运用行业分析、基本面分析、估值分析等方法,精选优质债券进行投资,从而达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产净值的增加。

6.投资组合策略

本基金将根据企业基本面分析和理论价值分析策略,在严格控制风险的前提下,精选具有投资价值的可转换债券,力争实现较高的投资收益。

7.剩余期限策略

本基金将根据剩余期限的长短,选择不同期限的债券进行投资,从而达到在严

格控制风险的基础上,实现基金资产净值的增加。

8.信用评级策略

本基金将根据信用债的信用评级,并结合信用债的信用风险程度,选择信用评级

较高的信用债进行投资。

9.基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。

10.基金资产净值

本基金的资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

11.基金的费用

本基金的费用包括基金管理费、托管费、销售服务费、赎回费、申购费、交易费、信息披露费、审计费、律师费、诉讼费、公证费、仲裁费、基金合同约定的其他费用。

12.基金的收益

本基金的收益是指基金资产总值减去负债后的余额。

13.基金的利润

本基金的利润是指基金的收益扣除由基金承担的费用后的余额。

14.基金的损失

本基金的损失是指基金的亏损。

15.基金的净值

本基金的净值是指基金资产总值减去负债后的余额除以基金的总份额。

16.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

17.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

18.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

19.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

20.基金的资产总值

本基金的资产总值是指基金拥有的所有财产的公允价值。

21.基金的负债总额

本基金的负债总额是指基金的债务的公允价值。

22.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

23.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

24.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

25.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

26.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

27.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

28.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

29.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

30.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

31.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

32.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

33.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

34.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

35.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

36.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

37.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

38.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

39.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

40.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

41.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

42.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

43.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

44.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

45.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

46.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

47.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

48.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

49.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

50.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

51.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

52.基金的资产

本基金的资产是指基金拥有的所有财产。

53.基金的负债

本基金的负债是指基金的债务。

54.基金的净资产

本基金的净资产是指基金的资产减去负债后的余额。

55.基金的资产净值

本基金的资产净值是指基金的净资产除以基金的总份额。

56.基金的资产