

(上接B055版)

法人代表:雷杰  
联系电话: (010) 572989062  
传真电话: (010) 572989062  
联系人员:徐锦福  
客服电话: 010-5658670  
公司网站: www.foundence.com

(57) 中原证券股份有限公司  
注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号  
法人代表: 陈明伟  
联系电话: 0371-6568670  
传真电话: 0371-65686705  
联系人员: 程宇航  
客服电话: 0371-967219 800-813-9666  
公司网站: www.cznew.com

(58) 中国银行金融租赁有限公司  
注册地址: 北京市建外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址: 北京市建外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
法人代表: 李剑刚  
联系电话: 010-65051166  
传真电话: 010-65051166  
联系人员: 陶亮  
客服电话: 010-59539718  
公司网站: www.cicx.com.cn

(59) 中期协基金管理(北京)有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层  
办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层  
法人代表: 陈明伟  
联系电话: 010-59539718  
传真电话: 010-59539701  
联系人员: 英俊英  
客服电话: 95162, 4008888160  
公司网站: www.cifcofund.com

(60) 广州农村商业银行股份有限公司  
注册地址: 广州市天河区珠江新城华夏路1号  
办公地址: 广州市天河区珠江新城华夏路1号  
法人代表: 王继康  
联系电话: 020-28019593  
传真电话: 020-22389014  
联系人员: 黎超雄  
客服电话: 020-961111  
公司网站: www.grcb.com

(61) 中国邮储银行股份有限公司  
注册地址: 北京市西城区金融大街3号  
办公地址: 北京市西城区金融大街3号  
法人代表: 李国华  
联系电话: (010) 68858057  
传真电话: (010) 68858057  
联系人员: 王硕  
客服电话: 95590  
公司网站: www.psbc.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它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: 长城基金管理有限公司  
住所: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16,17层  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16,17层  
电话: (021) 36301818  
传真: (021) 36361616  
联系人: 雷青松  
经办律师: 吕红, 黎明  
(四) 审计基金财产的会计师事务所  
名称: 安永华明会计师事务所有限责任公司  
注册地址: 上海市浦东新区长乐路1号东方广场东方经贸城安永大楼16层  
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼  
法定代表人: 葛明  
联系电话: 021-22288898  
传真: 021-22280000  
联系人: 徐鹤  
经办注册会计师: 徐鹤、蒋燕华

四、基金的名称

富国纯债债券型发起式证券投资基金

五、基金类型

债券型

六、基金的投资目标  
本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的收益以及长期稳定的投资回报。

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、同业存单、定期存款、资产支持证券、可分离交易的国债部分等金融工具以及法律法规规定可以投资的其他品种。

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,将其纳入基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为:投资于固定收益类资产的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%。

八、基金的投资策略

本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资

产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

(1) 整体资产配置策略

通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场价格走势、信用风险情况等因素的综合分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2) 类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下,根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利差补偿机制、附带选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动等因素,采取积极的投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最大权重。

(3) 明细资产配置策略

在明细资产配置上,首先根据期限、流动性指标、信用级别等对债券进行分类,根据个别债券的收益率与剩余期限的对比,对照基金的收跌率决定是否买入组合;然后,根据个别债券的流动性指标决定投资总量。

2. 流动性债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用定期控制策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等手段,对债券市场价格收益率以及各债券价格的变化进行跟踪,相机制,积累收益。

(1) 久期控制是根据对宏观经济状况、金融市场等特点等因素的分析

确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。

(2) 期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线特征确定合理的组织期限结构,包括运用集中策略、期限策略和限额策略等,在长期、中期和短期债券之间进行动态调整,从长、中、短期限债券的性价比中获利。

(3) 信用风险控制是管理人员充分利用行业与公司研究力量,根据股权投资的经济状况和现金流等条件对信用风险进行评估,以此作为品种选择的基本依据。信用产品投资是本基金的重点之一。

本基金认为,信用产品的运行中的中枢取决于基础利率的变动,也取决于发行人整体的信用状况。监管部门的政策指导,信用债券群体的投资理念及行为等变化决定了信用产品的定价区间,整个市场资金面的宽松程度以及信用债的供求状况等左右市场的短期预期。

基金经理将以上下对宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况、行业以及对宏观经济的动态跟踪,同时通过行业及券种选择等手段,灵活调整投资品种的久期,从而获得超额收益。

本基金将通过以下几方面对宏观经济形势以及流动性风险,以获得投资组合的稳定性,安全性中的中长期有效结合。

同一信用产品在不同市场状态下往往会有不同的表现,针对不同的表现,管理人员将采用不同的操作方式:如果信用二级市场利率高于管理人员判断的正常区间,管理人员在该信用品种上市时就寻找适当的机出卖实现利润;如果二级市场利率低于管理人员判断的正常区间,管理人员将持有一段时间卖出,获取这段时间的薄利和较高的期间的票息收益。本基金信用投资在操作上主要博取乘和票息收益,对于信用品种而言,这种时间换空间的操作方式决定了本基金管理人员在具体操作上必须在获取收益和防范风险之间取得平衡。

(4) 跨市场投资根据不同的证券市场的运行规则和风险特性,构建和调整整体投资组合,提升投资收益。

(5) 相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估,价格已经合理,高估价格下降的债券。

本基金对中小企业私募债的投资将遵循以下原则:

1) 基金经理对企业的尽职调查和评估;

2) 基金经理对企业的持续跟踪和评估;

3) 基金经理对企业的定期报告和财务信息的分析;

4) 基金经理对企业的估值和定价。

3. 回购套利策略

回购套利策略是本基金重要的操作策略之一,把信用产品投资和回购交易结合起来,管理人员根据信用产品的特征,在信用风险和流动性风险的控制的前提下,或者通过回购的信用风险和回购的票息收益,或者通过回购的流动性来套取信用收益和资金的本息。

4. 投资决策与交易机制

本基金设立投资决策委员会负责领导下的基金日常经营负责制。

投资决策委员会负责审核本基金的大类资产配置比例,组合基准久期、回购的最高比例等重要投资决策。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略,向其交易账户下达投资指令。

基金经理还须对债券交易员,负责执行投资指令,就指令执行过程中的问题及市场上的变化情况向执行的交易员及时向基金经理反馈,并可提出基于市场的具体建议,集中交易账户对负责各项投资限制的基金经理负责以及本基金投资平台上显示基金之间的公平交易控制。

5. 投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内,制定具体的基金组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

(1) 基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点,结合基金合同、投资风格拟订投资策略报告。

(2) 投资决策报告提交给投资决策委员会,投资决策委员会审批决定基金的投资方案,大类资产分布比例,组合基准久期,回购比例等重要事项。

(3) 基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、组合基准久期和投资分析方式等。

(4) 对已投资品种进行跟踪,对投资组合进行动态调整。

九、业绩基准

本基金业绩比较基准为:中债综合指数。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券基金,属于固有资金投资中的较低风险品种,其预期风险与预期收益均低于货币市场基金,低于混合型基金股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

1. 报告期末基金资产组合情况

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 729,094,797.61 92.36

其中:债券 729,094,797.61 92.36

货币市场基金 - -

3 贵金属 - -

4 金融衍生品投资 34,000,000.00 4.31

5 其他资产 - -

6 衍生工具 - -

7 其他资产 19,711,935.67 2.50

8 合计 894,810,131.43 100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期末未持有股票资产。

十二、邮政编码:510663

十三、联系电话:020-32290069

(二) 信息披露义务人及其主要负责人:

姓名 性别 本公司职务 国籍 是否取得其他国家和地区的永久居留权 长期居住地

凤阳 女 董事长 中国 是

次婉 女 董事 中国 是

李学军 男 董事 中国 是

(三) 信息披露义务人持有、控制其他境内或境外上市公司的发行在外股份总额百分之五以上的情况:

截止本报告书签署之日,广州高金技术产业集团有限公司除持有毅昌股份外,还有高盟新材37.53%,东材料99.29%的发行在外的股份。

十三、第三节 权益变动的目的

信息披露义务人减持股份的目的是自身经营需要。

在未来12个月内,信息披露义务人存在继续减持毅昌股份的可能性,若发生相关权益变动事项,将按照相关法律法规履行信息披露义务。

十四、第四节 权益变动方式

一、 一般股东变动

广州高金技术产业集团有限公司在2015年1月5日通过深圳证券交易所大宗交易平台减持毅昌股份20,000,900股,占公司总股本的0.30%,仍为公司的控股股东。

本次减持不涉及对控股股东和实际控制人变动。具体情况如下:

一、股东减持情况

1、股东本次减持情况

股东名称 股份性质 本次减持前持有股份 本次减持后持有股份

股数(股) 比例(%) 股数(股) 比例(%)

合计 141,049,240 35.17 121,039,340 30.18

其中:无限售条件股份 141,049,240 35.17 121,039,340 30.18

有限售条件股份 0 0 0 0

二、其他相关说明

1、广州高金技术产业集团有限公司(以下简称“公司”)于2015年1月5日接到公司控股股东广州高金技术产业集团有限公司(以下简称“广州高金”)的通知,广州高金于2015年1月5日通过深圳证券交易所大宗交易系统减持公司股份20,000,900股,占公司总股本的0.30%,仍为公司的控股股东。

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,将其纳入基金的投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于固定收益类资产的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%。

八、基金的投资策略

本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

(1) 整体资产配置策略

通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场价格走势、信用风险情况等因素的综合分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2) 类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下,根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利差补偿机制、附带选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动等因素,采取积极的投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最大权重。

(3) 明细资产配置策略

在明细资产配置上,首先根据期限、流动性指标、信用级别等对债券进行分类,根据个别债券的收益率与剩余期限的对比,对照基金的收跌率决定是否买入组合;其次,根据个别债券的流动性指标决定投资总量。

2. 流动性债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用定期控制策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等手段,对债券市场价格收益率以及各债券价格的变化进行跟踪,相机制,积累收益。

(1) 久期控制是根据对宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况等的因素的分析

确定组合的整体久期,也取决于发行人整体的信用状况。

(2)