

(上接B005版)

法定代表人:黄俊辉
联系人:张立新
联系电话:010-58276789
(78)上海利得基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区崮山路457号1033室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路2号高科大厦4楼
法定代表人:余磊
客服电话:(027)87618889
公司网址:<http://www.tzq.com>
基金管理人根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售其基金,并及时公告义务。

四、基金的名称

本基金名称:工银瑞信信用添利债券型投资基金

五、基金的类型

本基金类型:债券型基金

六、基金的投资目标

在控制风险与保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

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,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、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。

如法律法规或监管部门以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券类资产(不含转换债券)的比例不低于基金资产的90%,其中,基金持有的公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等金融产品,发行票面到期日前的固定收益类资产投资比例不低于债券资产的80%;投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,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%。

本基金将通过投资首次公开发行股票、增发新股、可转换债券转股以及权证等方式获得股票,不得直接从二级市场买入股票。

八、基金的投资策略**1. 策略概述**

通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量,分析宏观经济运行的基本情况,并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及特征。在此基础上,预测金融市场价格变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

结合久期是反映利率风险最重要的指标,本基金将根据对市场利率变化趋势的预测,制定出组合的久期策略;预期市场价格水平将上升时,降低组合的久期;预期市场价格将下降时,提高组合的久期。

2. 策略执行

通过策略组合模型,在权限范围内,评估债券的投资价值,选择构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合的日常管理。

3. 交易执行

交易员负责合法合规的前提下,执行基金经理的投资指令。

4. 风险管理及绩效评估

风险管理专业人员对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估,报告风

险管理人员,抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理,并就基金的投资组合提出风险预警。

法律合规部对基金的投资行为进行合规性监控,并对投资过程中存在的风险隐患向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会提出书面风险提示。

九、基金的业绩比较基准

基金经理根据投资决策委员会的决议,在权限范围内,评估债券的投资价值,

选择构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合的日常管理。

十、基金的收费和费用

本基金为债券型基金,属于低风险基金品种。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告期自2014年7月1日起至9月30日止(财务数据未经审计)。

1. 报告期末未按基金资产组合情况**序号****项目****金额(元)****占基金总资产的比例(%)****1 股权投资****2 债券投资****3 固定收益类投资****4 贵金属投资****5 衍生品投资****6 其他投资****7 货币市场基金****8 其他****9 合计****注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。****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 国库券****2 央行票据****3 金融债****4 政策性金融债****5 企业债****6 企业短期融资券****7 中期票据****8 可转债****9 其他****注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。****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**

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

9. 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 国库券****2 央行票据****3 金融债****4 政策性金融债****5 企业债****6 企业短期融资券****7 中期票据****8 可转债****9 其他****注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。****10. 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组合**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11. 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。

12. 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

13. 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 国库券****2 央行票据****3 金融债****4 政策性金融债****5 企业债****6 企业短期融资券****7 中期票据****8 可转债****9 其他****注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。****14. 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组合**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

15. 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。

16. 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

17. 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 国库券****2 央行票据****3 金融债****4 政策性金融债****5 企业债****6 企业短期融资券****7 中期票据****8 可转债****9 其他****注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。****18. 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组合**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

19. 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。

20. 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

21. 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 国库券****2 央行票据****3 金融债****4 政策性金融债****5 企业债****6 企业短期融资券****7 中期票据****8 可转债****9 其他****注:由于四舍五入的原因基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。****22. 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组合**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

23. 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。

24. 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

25. 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 国库券****2 央行票据****3 金融债**