证券代码:002195　证券简称:海隆软件　公告编号:2015-005

上海海隆软件股份有限公司首次公开发行前已发行股份上市流通及相关股东追加承诺的提示性公告

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、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示:

1、公司首次公开发行前已发行股份本次解除限售的数量为5,019,299股,占公司股本总额的1.44%,其中4,997,849股因股东追加承诺继续锁定(详见《关于实际控制人及其一致行动人追加承诺的公告》,公告编号:2014-003)。因此本次限售股解限数量为21,450股,占公司总股本的0.0062%。公司将在本次限售股份上市流通日起的两个交易日内完成追加承诺相关股份的申请锁定手续。

2、本次限售股份上市流通日为2015年02月06日。

一、首次公开发行前已发行股份概况

上海海隆软件股份有限公司(以下简称"海隆软件"、"本公司"或"公司")首次公开发行前股本为4,290万股,首次向社会公开发行1,450万股,并于2007年12月12日在深圳证券交易所中小企业板上市,上市时股本总额为5,740万股。

截止本信息披露日,公司总股本为348,693,088股,首次公开发行前已发行股份中尚未解除限售的股份总额为5,019,299股。

公司上市后首次公开发行前已发行股份变化情况如下:

1、公司2008年5月12日召开了2007年度股东大会审议通过公司《2007年度利润分配及资本公积金转增股本方案》,其中,以公司2007年末的总股本5,740万股为基数,每10股转增3股。本次转增后,公司股本总额为7,462万股,未解除限售股股份总额为55,770,000股。

2、公司于2008年12月9日披露了《上海海隆软件股份有限公司限售股份上市流通提示性公告》(公告编号2008-035)。公司申请于2008年12月12日对部分股东的股票按承诺进行解禁。此次申请全部解除限售股东人数为1人,解除限售股份的总数为13,384,800股,占2008年12月12日公司股本总额的17.94%。

3、公司于2010年12月8日披露了《上海海隆软件股份有限公司限售股份上市流通提示性公告》(公告编号2010-026)。公司申请于2010年12月13日对部分股东的股票按承诺进行解禁。此次申请全部解除限售股东为1人,申请部分解除限售股东为39人,解除限售股份的总数为20,216,625股,占2010年12月13日公司股本总额的27.09%。

4、公司2011年5月12日召开了2010年度股东大会审议通过公司《2010年度利润分配及资本公积金转增股本方案》,其中,以公司2010年末的总股本7,462万股为基数,每10股转增5股。本次转增后,公司股本总额为11,193万股,未解除限售股股份总额为33,252,862股。

5、公司于2011年12月8日披露了《上海海隆软件股份有限公司限售股份上市流通提示性公告》(公告编号2011-034)。公司申请于2011年12月12日对部分股东的股票按承诺进行解禁。此次申请部分解除限售股东人数为39人,解除限售股份的总数为9,411,188股,占2011年12月12日公司股本总额的8.41%。

6、公司于2012年12月7日披露了《上海海隆软件股份有限公司限售股份上市流通提示性公告》(公告编号2012-028)。公司申请于2012年12月12日对部分股东的股票按承诺进行解禁。此次申请部分解除限售股东人数为39人,解除限售股份的总数为9,411,187股,占2012年12月12日公司总股本11,396万股的8.26%。

7、公司于2014年01月08日披露了《上海海隆软件股份有限公司限售股份上市流通提示性公告》(公告编号2014-002)。公司申请于2014年01月10日对部分股东的股票按承诺进行解禁。此次申请部分解除限售股东人数为39人,解除限售股份的总数为9,411,188股,占2014年01月10日公司总股本11,333万股的8.30%。

二、申请解除股份限售股东履行承诺情况

1、公司以包叔平先生为代表的38位自然人股东承诺:自公司股票上市之日起三十六个月内,不转让或者委托他人管理其所持有的发行人股份,也不由发行人回购其所持有的股份;之后每年转让不超过所持有发行人股份的20%。

包叔平先生为代表的38位自然人股东在上市前所做出的上述承诺,是指相关股东将其所持有的公司公开发行前股份以及由持有公开发行前股份因转增股本、送红股等权益性分派所增加的股份,在锁定期满后每年可以解锁并上市流通不超过20%,满5年后可以全部解锁完毕并全部上市流通。担任董事、监事和高级管理人员每个年度可转让股份的最高额度,不得超过《公司法》、《证券法》及《深圳证券交易所上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理业务指引》的规定。

2、2013年12月,公司董事会收到公司实际控制人包叔平先生及其一致行动人出具的承诺函,基于包叔平先生作为收购主体以要约方式收购公司股份事宜(相关内容详见公司在2013年12月20日披露的《要约收购报告书摘要》),包叔平先生及其一致行动人就所持公司股份追加限售期等事项作出承诺:基于包叔平先生作为收购主体以要约方式收购公司股份事宜,包叔平先生及其一致行动人作出承诺,在海隆软件停牌之日(2013年11月1日)起的6个月内以及本次要约收购完成前不买卖海隆软件的股票,并在本次要约收购完成后的12个月内不转让所持海隆软件的股票。

6、现任及历任公司董事、监事、高级管理人员的包叔平、陆庆、潘世雷、李静、王彬、董樑、李海婴、李志清、唐长钧及王刚等10名股东还承诺:除前述锁定期外,在其任职期间每年转让的股份不超过其所持有公司股份总数的25%;申报离任六个月内,不转让其所持有的公司股份;申报离任六个月后的十二个月内通过证券交易所挂牌交易出售本公司股票数量占其所持有本公司股票总数(包括有限售条件和无限售条件的股份)的比例不超过50%。

经核查,上述承诺均得到严格履行。除上述承诺以外,无其他与本次上市流通股份相关的承诺情况。

本次申请解除股份限售的所有股东均不存在非经营性占用上市公司资金的情况,本公司未对该等股东提供任何担保。

三、本次限售股份上市流通安排

1、本次限售股份上市流通日为2015年02月06日。

2、公司首次公开发行前已发行股份中本次解除限售的数量为5,019,299股,占公司股本总额348,693,088股的1.44%,其中4,997,849股因股东追加承诺继续锁定(详见《关于实际控制人及其一致行动人追加承诺的公告》,公告编号:2014-003)。公司将在本次限售股份上市流通日起的两个工作日内根据上述追加承诺,在中国证券登记结算公司深圳分公司办理完成包叔平先生及其一致行动人的相关股份锁定事宜。因此本次限售股解限数量为21,450股,占公司总股本的0.0062%。

3、本次申请解除限售的股东数为:自然人股东38人。

4、各限售股份解除限售具体情况:

序号	限售股份持有人名称	持有限售股份总数(股)	本次解除限售数量(股)	职务	质押、冻结情况
1	包叔平	858,000	858,000	董事长/总经理	无质押、无冻结
2	唐长钧	702,487	702,487		无质押、无冻结
3	姚钢	390,390	390,390		无质押、无冻结
4	周诚	362,505	362,505		无质押、无冻结
5	李坚	334,620	334,620		无质押、无冻结
6	陆庆	171,600	171,600	原监事,已于2014年12月1日辞职	无质押、无冻结
7	潘世雷	171,600	171,600	董事/副总经理	无质押、无冻结
序号	限售股份持有人名称	持有限售股份总数(股)	本次解除限售数量(股)	职务	质押、冻结情况
8	杨晓鸣	134,062	134,062		无质押、无冻结
9	金晶	107,250	107,250		无质押、无冻结
10	李斌	107,250	107,250		无质押、无冻结
11	王洪祥	111,540	111,540		无质押、无冻结
12	丁国骏	107,250	107,250		无质押、无冻结
13	程中	93,522	93,522		无质押、无冻结
14	王刚	85,800	85,800		无质押、无冻结
15	刘庆	85,800	85,800		无质押、无冻结
16	李海婴	85,800	85,800	原副总经理,于2014年11月17日辞职	无质押、无冻结
17	李静	85,800	85,800	副总经理/董事会秘书	无质押、无冻结
18	沈斌	85,800	85,800		无质押、无冻结
19	王彬	85,800	85,800	职工监事	无质押、无冻结
20	李志清	78,936	78,936	监事会主席	无质押、无冻结
21	程洁	76,362	76,362		无质押、无冻结
22	张弘	70,278	70,278		无质押、无冻结
23	蒋伟成	66,924	66,924		无质押、无冻结
24	董樑	64,350	64,350	会计机构负责人	无质押、无冻结
25	刘晓民	50,193	50,193		无质押、无冻结
26	张经伟	42,900	42,900		无质押、无冻结
27	郑凯	42,900	42,900		无质押、无冻结
28	刘叶妹	42,042	42,042		无质押、无冻结
29	姚斌	42,042	42,042		无质押、无冻结
30	陆金久	41,262	41,262		无质押、无冻结
31	沈龙根	34,320	34,320		无质押、无冻结
32	朱晓冬	34,320	34,320		无质押、无冻结
33	郭伟忠	34,320	34,320		无质押、无冻结
34	李晓豫	33,462	33,462		无质押、无冻结
35	王奕	33,462	33,462		无质押、无冻结
36	严晓月	30,030	30,030		无质押、无冻结
37	夏芳芳(见注1)	21,450	21,450		无质押、无冻结
38	殷健	12,870	12,870		无质押、无冻结
		5,019,299	5,019,299		

注:1、2009年7月,原为包叔平先生一致行动人的自然人夏芳芳因病去世,其与包叔平的委托受托关系自然终止;

2、其余一致行动人股东均作出追加承诺,承诺内容详见《关于实际控制人及其一致行动人追加承诺的公告》(公告编号:2014-003);

3、本次申请解除限售的数量为5,019,299股,其中4,997,849股因追加承诺继续锁定,该部分股份性质将由"首发前个人类限售股"变为"首发后个人类限售股",不上市流通。因此本次申请解除限售数量为21,450股。

四、备查文件

1、上海海隆软件股份有限公司限售股份上市流通申请书

2、上海海隆软件股份有限公司中小板上市公司限售股份上市流通申请表

3、股本结构表

4、限售股份明细数据表

5、一致行动人追加承诺的承诺函

特此公告。

上海海隆软件股份有限公司
董事会
2015年02月03日

证券代码:002195　证券简称:海隆软件　公告编号:2015-006

上海海隆软件股份有限公司关于筹划重大事项继续停牌的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

上海海隆软件股份有限公司(以下简称"公司")正在筹划重大事项,公司股票已于2015年1月27日开市起停牌。由于相关事项存在不确定性,为避免引起公司股价异常波动,保证公平信息披露,维护投资者利益,根据《深圳证券交易所股票上市规则》有关规定,经公司向深圳证券交易所申请,公司股票(证券简称:海隆软件,证券代码:002195)继续停牌,待公司披露相关事项后复牌。停牌期间,公司将根据事项进展情况,严格按照有关规定及时履行信息披露义务。

公司指定的信息披露媒体为《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn/),敬请投资者关注相关公告并注意投资风险。

特此公告。

上海海隆软件股份有限公司
董事会
2015年2月3日

证券代码:000665　证券简称:湖北广电　公告编号:2015-011

湖北省广播电视信息网络股份有限公司关于获得中央文化产业专项资金的公告

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。

近日,湖北省广播电视信息网络股份有限公司(以下简称"公司")收到《湖北省财政厅关于下达2014年中央文化产业专项资金的通知》(鄂财教发[2014]152号),根据《财政部关于下达2014年文化产业发展专项资金的通知》(财文资[2014]23号)精神,一次性下达公司中央文化产业发展专项资金900万元,目前该项目补助资金已到账。

据统计,2014年公司共收到政府支持文化产业专项资金和文化事业建设补助资金累计为1330万元。

公司将根据《企业会计准则》等有关规定对上述补助资金进行会计处理,具体以会计师年度审计确认后的结果为准,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告

湖北省广播电视信息网络股份有限公司董事会
二〇一五年二月三日

兴业全球基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告

根据兴业全球基金管理有限公司(以下简称"本公司")与联讯证券股份有限公司(以下简称"联讯证券")签订的销售协议,自2015年2月6日起,增加联讯证券为本公司旗下部分基金的销售机构。业务办理的具体事宜请遵从联讯证券的相关规定。同时,下表所列基金开通在联讯基金销售的前端定期定额投资业务和基金前端转换业务。

基金名称	基金简称	基金代码
兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)	兴全趋势投资混合(LOF)	前收费163402 后收费163403
兴全合润分级股票型证券投资基金	兴全合润分级股票	163406
兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)	兴全300指数(LOF)	前收费163407 后收费163408
兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)	兴全绿色投资股票(LOF)	前收费163409 后收费163410
兴全保本混合型证券投资基金	兴全保本混合	163411
兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)	兴全轻资产股票(LOF)	前收费163412 后收费163413
兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)	兴全商业模式股票(LOF)	前收费163415 后收费163416
兴全可转债混合型证券投资基金	兴全可转债混合	340001
兴全货币市场证券投资基金	兴全货币	340005
兴全全球视野股票型证券投资基金	兴全全球视野股票	340006
兴全社会责任股票型证券投资基金	兴全社会责任股票	340007
兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金	兴全有机增长混合	340008
兴全稳稳增利债券型证券投资基金	兴全稳稳增利债券	340009

一、定期定额投资业务

1、凡申请办理上述基金定投业务的投资者,须开立相关开放式基金账户。已开户者除外,具体开户程序遵循联讯证券的相关规定。已开立上述基金账户的投资者可携带有效身份证件及相关业务凭证,具体办理程序遵循联讯证券的相关规定。

2、一只基金的每期扣款(申购)最低金额为人民币300元(含申购费)。

3、定期定额申购的申购费率和计费方式与日常申购业务相同,详见各相关基金的《招募说明书》(更新)。

4、关于基金定期定额投资业务的具体规则,敬请投资者详细阅读本公司2006年8月4日刊登的《兴业基金管理有限公司关于旗下基金开办定期定额投资业务的公告》及其他相关公告。

二、基金转换业务

1、基金转换是指投资者可将其通过销售机构购买并持有的本公司旗下某只开放式基金的全部或部分基金份额,转换为本公司管理的,且属同一注册登记机构的另一只开放式基金的份额的行为。目前,本公司仅接受场外前端申购模式的基金转换申请。

2、基金转换费用由转出基金赎回费和转换补差费组成,即:基金转换费=转出基金赎回费 + 转换补差费。从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时,每次按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额收取转换补差费;从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时,不收取转换补差费。具体转换费用的费率详见http://www.xyfunds.com.cn/column.do?mode=searchtopic&channelid=10&categoryid=664&childcategoryid=3779。

3、除兴全趋势投资混合(LOF)的最低赎回、转换转出及最低持有份额为30份外,其余基金的最低赎回、转换转出及最低持有份额为100份,若基金份额持有人单个交易账户中单只基金份额余额低于上述转换最低份额,当基金份额持有人申请将账户中该基金全部份额进行转换为另一只基金时,不受上述转换最低份额限制。

当基金份额持有人的某笔转换申请导致单个交易账户的基金份额余额少于上述最低持有份额时,余额部分基金份额将被强制赎回。敬请投资者注意转换份额的设定。

三、销售机构情况

联讯证券股份有限公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号
法定代表人:徐刚
客户服务电话:95564?
?基金业务传真:010-64408834
公司网站:http://www.lxzq.com.cn/
投资者也可通过以下途径咨询有关详情
兴业全球基金管理有限公司客服电话:400-678-0099(免长话)、021-38824536
?兴业全球基金管理有限公司网站:http://www.xyfunds.com.cn

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险,请仔细阅读《基金合同》、《招募说明书》及相关公告。

投资者投资于本公司旗下基金时应认真阅读相关基金的基金合同、招募说明书,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

兴业全球基金管理有限公司
2015年2月3日

关于解聘兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金经理的公告

公告送出日期:2015年2月3日

1 公告基本信息

基金名称	兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)
基金简称	兴全绿色投资股票(LOF)
基金主代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金管理人名称	兴业全球基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等相关法规
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	杨岳斌
离任基金经理姓名	陈锦泉

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	陈锦泉
离任原因	公司安排转任专户投资部总监
离任日期	2015-02-03
是否转任本公司其他工作岗位	是
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	否

3 其他需要说明的事项

上述变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会办理相应手续,并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

特此公告。

兴业全球基金管理有限公司
2015年2月3日

证券代码:002194　证券简称:武汉凡谷　公告编号:2015-007

武汉凡谷电子技术股份有限公司关于筹划员工持股计划股票停牌的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

武汉凡谷电子技术股份有限公司(以下简称"公司")正在筹划员工持股计划相关事项,鉴于该事项尚存在不确定性且难以保密,为维护广大投资者的利益,保证公平信息披露,避免对公司股价造成重大影响,根据《深圳证券交易所股票上市规则》的有关规定,经公司向深圳证券交易所申请,公司股票(证券简称:武汉凡谷,证券代码:002194)自2015年2月3日(星期二)开市起停牌,待公司通过指定媒体发布相关公告后复牌。

敬请广大投资者关注相关公告并注意投资风险。

特此公告。

武汉凡谷电子技术股份有限公司
董　事　会
二〇一五年二月三日

证券代码:600756　证券简称:浪潮软件　公告编号:2015-005号

浪潮软件股份有限公司重大资产重组进展公告

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。

因本公司正在筹划重大事项,经公司申请,本公司股票已于2015年1月13起停牌,后经各方论证和协商,上述事项对公司构成了重大资产重组,为保证公平信息披露,维护投资者利益,避免造成公司股价异常波动,经公司申请,本公司股票自2015年1月27日起停牌,预计停牌不超过一个月。

目前,公司正在按照《上市公司重大资产重组管理办法》及其他有关规定,积极开展中介机构选聘、尽职调查、重组方案论证等工作。

停牌期间,本公司将根据重大资产重组的进展情况,及时履行信息披露义务,每5个交易日发布一次有关事项的进展情况。待有关事项确定后,公司将及时公告并复牌。

公司指定信息披露媒体为《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(www.sse.com.cn),公司所有信息均以指定媒体正式公告为准,敬请广大投资者关注本公司后续公告。

鉴于该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。

浪潮软件股份有限公司
2015年2月2日

证券代码:000856　证券简称:冀东装备　公告编号:2015-5

唐山冀东装备工程股份有限公司关于控股股东申请豁免要约收购义务获得中国证监会核准的公告

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。

2015年2月2日,公司收到控股股东冀东发展集团有限责任公司(以下简称"冀东发展")送达的中国证券监督管理委员会证监许可[2015]136号《关于核准豁免冀东发展集团有限责任公司要约收购唐山冀东装备工程股份有限公司股份义务的批复》:

一、核准豁免冀东发展和因执行法院裁定而增持唐山冀东装备工程股份有限公司24,100,000股股份,导致合计持有该公司91,978,421股股份,约占该公司总股本的40.52%而应履行的要约收购义务。

二、冀东发展应当按照有关规定及时履行信息披露义务。

三、冀东发展应当会同唐山冀东装备工程股份有限公司按照有关规定办理相关手续。

特此公告。

唐山冀东装备工程股份有限公司
董　事　会
2015年2月2日

证券代码:000506　证券简称:中润资源　公告编号:2015--09

中润资源投资股份有限公司关于公司重大资产重组的进展公告

本公司及董事会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。

中润资源投资股份有限公司(以下简称"公司")由于筹划重大事项,经公司申请,公司股票于2014年11月4日开市时停牌。2014年12月2日,公司刊发《关于公司重大资产重组停牌的公告》,筹划的重大事项涉及发行股份购买资产,构成重大资产重组。

目前,重大资产重组事项的相关工作仍在进行中。该事项仍存在不确定性,公司股票将继续停牌。

本次筹划的重大资产重组事项,尚存在较大不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

中润资源投资股份有限公司
董事会
2015年2月2日

(上接B42版)

办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
联系人:王天
客服电话:400-001-8811
公司网站:www.zcvc.com.cn
40)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:段京璐
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
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理销售本基金,并及时公告。

2、场内发售机构

通过上海证券交易所(以下简称"上证所")基金销售系统办理相关业务的上证所会员单位(具体名单见上证所网站)。

(二)注册登记机构

中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-59378839
传真:010-59378907
联系人:朱立元

(三)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
注册地址: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
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:安冬
经办律师:安冬、孙睿

(四)提供验资服务的会计师事务所

瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层
法定代表人:杨剑涛
电话:010-88219191
传真:010-88210558
经办注册会计师:李荣坤、张吉范
联系人:李荣坤

四 基金合同的生效

(一)基金备案的条件

本基金合同已于2012年12月21日生效。

(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会。

五 基金的名称

本基金名称:新华纯债添利债券型发起式证券投资基金。

六 基金的类型

基金类型:契约型开放式。

七 基金的投资目标

本基金通过对债券组合的久期、期限结构、类属品种以及单个债券进行积极主动的配置,力争在严格控制投资组合风险的同时,提高基金资产的流行性及收益率水平,为投资者提供长期稳定的投资回报。

八 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,包括国债、央行票据、地方政府债、城投债、金融债、企业债(含中小企业私募债)、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产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,但须符合中国证监会相关规定。

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

九 基金的投资策略

本基金的投资策略主要包括:利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值,积极主动进行类属品种配置及个券选择,谋求基金资产的长期稳定增值。

1、利率预期策略

利率预期策略的目标是在预期利率上升时保全资本,预期利率下降时获得较高的资本利得。本基金将通过综合分析宏观经济指标(如国内生产总值、工业增加值、固定资产投资增速、价格指数、消费增长率、m1、m2、信贷增长、汇率、国外利率等)、宏观政策(如货币政策、财政政策、汇率政策等)以及市场指标(如新债券的发行利率与市场收益率的差异、中央银行的公开市场操作、回购利率等)预测利率的变动方向、范围和幅度。

具体而言,当预期利率上升,本基金将缩短债券组合的平均久期,规避市场风险。当预期利率下降,本基金将增加债券组合的平均久期,获取因利率下降所带来的资本利的收益。

2、类属品种配置策略

(1)收益率曲线策略

本基金在短期、中期、长期品种的配置上主要采用收益率曲线策略。

债券收益率曲线形状在受到央行货币政策、公开市场操作、经济增长率、通货膨胀率、货币供应量和市场预期等多种因素的影响下,可能发生平行移动、非平行移动(平坦化、陡峭化、扭曲)等变动。收益曲线策略就是通过对市场收益率曲线的非平行变动预期,追求获得因收益曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。

本基金将用情景分析的手段比较不同的收益曲线投资策略,即子弹策略(构成组合的证券期限集中于收益率曲线上某一点)、梯形策略(构成组合内每种期限的证券数量基本相当)和哑铃策略(构成组合中的证券的期限集中到两个极端期限),采取当时市场状况下相应的最优投资策略,确定债券资产中短期、中期、长期品种的配置比例。

(2)信用利差策略

本基金在国债、金融债、信用债等品种的配置上主要采用信用利差策略。

当宏观经济由衰退转为繁荣时,投资者具有更高的风险溢价,促使信用债和国债之间的信用利差缩小,此时应增加信用债配置比例,降低国债配置比例;而当经济由繁荣转向衰退时,投资者避险情绪严重,促使信用债和国债之间的信用利差扩大,此时应降低信用债配置比例,增加国债配置比例。

本基金将采用定性与定量相结合的方法,分析宏观经济运行方向以及利差的合理变动空间,动态调整不同债券类别的配置比例。

3、证券选择策略

(1)信用债券选择策略

本基金主要投资于具有国内信用评级机构认定的债券评级在AAA级以下、BBB级以上(含BBB级)的投资级信用债券。

本基金将通过自上而下与自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略是指本基金将从经济周期、国家政策、行业轮动和债券市场的供求状况等多个方面对利差走势及其收益和风险进行判断;自下而上策略是指本基金将采用行业分析方法及公司财务分析方法对债券发行主体的基本面进行深入研究,通过内外结合的信用研究和评级制度,确定发债主体的实际信用状况,筛选风险与收益相匹配的优质债券进行配置。同时,本基金将采取适当方法进行信用风险的控制。具体而言:

(1)在自上而下的信用利差分析方面,本基金将重点关注如下因素:

① 经济周期:经济周期的变化对信用利差曲线的变化影响很大,在经济上行阶段,企业盈利状况持续向好,经营现金流改善,则信用利差可能收窄,而当经济步入下行阶段时,企业的盈利状况减弱,信用利差可能会随之扩大。

② 国家政策也会对信用利差造成很大的影响,例如政策放宽企业发行信用债的审核条件,则将扩大发行主体的规模,进而扩大市场的供给,信用利差有可能扩大。

③ 行业景气度的好转往往会推动行业内发债企业的经营状况改善,盈利能力增强,从而可能使得信用利差相应收窄,而行业景气度的下行可能会使得信用利差相应扩大。

④ 债券市场供求、信用债券市场结构和信用债券品种的流动性等因素的变化趋势也会在较大程度上影响信用利差曲线的走势,比如,信用债发行利率提高,相对于贷款的成本优势减弱,则信用债券的发行可能会减少,这会影响到信用债市场的供求关系,进而对信用利差曲线的变化趋势产生影响。

(2) 在自下而上的信用等级评估方面, 本基金将借助本基金管理人内部的行业及公司研究员的专业研究能力,并综合参考外部权威、专业研究机构的研究成果,对发债主体进行深入的基本面分析,并结合债券的发行条款(包含期限、票息率、赋权特点、增信方式、提前偿还和赎回等条款),以确定信用债券的实际信用风险状况及其信用利差水平,挖掘并投资于信用风险相对较低、信用利差相对较大的优质品种。具体的分析内容及指标包括但不限于国民经济运行的周期阶段、债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况(包含盈利能力、偿债能力、现金流获取能力、运营能力等)、管理水平及其债务水平等。

(3)本基金从如下方面进行信用风险控制:

① 根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级,依靠公司内部信用分析团队,同时整合公司外部有效资源,深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况

② 严格遵守信用类债券的备选库制度,根据不同的信用风险等级,按照不同的投资管理流程和权限管理制度,对入库债券进行定期信用跟踪分析。

③ 采取分散化投资策略和集中度限制,严格控制组合整体的违约风险水平。

(2)中小企业私募债券选择策略

本基金主要通过定量与定性相结合的研究及分析方法进行中小企业私募债券的选择和投资。定性分析重点关注所发行债券的具体条款以及发行主体情况。

① 定量分析

定量分析方面,本基金重点关注债券发行人的财务状况,包括发行主体的偿债能力、盈利能力、现金流获取能力以及发行主体的长期资本结构等。具体关注指标如下:

i. 偿债能力:重点关注流动比率、速动比率、利息保障倍数以及现金利息保障倍数等指标;
ii. 盈利能力:重点关注ROE、ROA、毛利率以及净利率等指标;
iii. 现金流获取能力:重点关注销售现金比率、资产现金回收率等指标;
iv. 资本结构:重点关注资产负债率指标。

②定性分析

定性分析重点关注所发行债券的具体条款以及发行主体情况。主要包括债券发行的基本条款(包括私募债券名称、本期发行总额、期限、票面金额、发行价格或利率确定方式、还本付息的期限和方式等)、募集资金用途、转让范围及约束条件、偿债保障机制、股息分配政策、担保增信情况、发行主体历史发行债券及评级情况以及发行主体主营业务发展前景等方面。

(3)收益率曲线骑乘策略

债券收益的来源主要由两大部分组成,第一部分是息票收入,第二部分是资本利得收入。在息票收入固定的情况下,通过主动式债券投资的管理,尽可能多的获取资本利得收入是提高本基金收益的重要手段。而资本利得收入主要是通过债券收益率下降取得的,基于此,本基金提出了骑乘策略。

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度,若收益率曲线较为陡峭,则随着债券剩余期限的缩短,债券的收益率水平将会有较大下滑,进而获得较高的资本利得。

(4)债券互换

债券互换是指卖出某债券的同时,买入另一种相似特征债券以提高收益率的一种策略,其实质是债券价值挖掘的一种延伸。

(5)杠杆放大策略

当债券市场出现上升行情时,由于现券收益率较高,市场资金成本较低时,本基金可以不断利用正回购的方式进行滚动操作,放大资金规模,获得超额收益。当债券市场出现下降行情时,由于现券收益率低,市场资金成本高时,本基金可以通过买断式逆回购,在降低债券仓位的同时获取超额收益。

(6)资产支持证券的投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等。可以从信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素等五个方面进行考虑。其中信用因素是目前最重要的因素,本基金运用CreditMetrics模型——信用矩阵来估计信用利差。该模型的方法主要是估计一定期限内,债务及其它信用类产品构成的组合价值变化的远期分布。这种估计是通过建立信用评级转移矩阵来实现的。其中先对单个资产的信用风险进行分析,然后通过考虑资产之间的相关性和风险头寸,把模型推广到多个债券或贷款的组合。

十 基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:中债新综合指数(全价)。

中债新综合指数(全价)由中央国债登记结算公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场,成份券种包括除资产支持债和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。

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,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致,但无需基金份额持有人大会审议。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前 2 日在至少一种指定媒体上进行公告并报中国证监会备案。

十一 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

十二 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本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截至2014年9月30日。

(一) 报