

上接B070版

联系电话:020-38286651
 邮箱:wangxin@wlzq.com.cn
 63)五矿证券有限公司
 注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
 室47层01单元
 室48层
 法定代表人:张永衡
 电话:0755-82545555
 公司网站:http://www.wkzq.com.cn/wkzq/web/index.aspx

64)西藏同信证券股份有限公司
 注册地址:拉萨市北京中路101号
 联系人:汪尚斌
 网址:www.xzsec.com
 客户服务电话:400-881-1177
 65)西南证券股份有限公司
 注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
 法定代表人:余维佳
 客户服务电话:4008-096-096
 网址:www.swsc.com.cn
 66)厦门证券有限公司
 地址:厦门市莲前西路2号
 客户服务电话:0592-5163588
 公司网址:www.xmzq.cn
 67)湘财证券有限责任公司
 注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
 办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
 法定代表人:林俊波
 电话:021-68634518
 传真:021-68865680
 联系人:赵小期021-68634510-8620
 客服电话:400-888-1151
 公司网址:www.xcsc.com
 68)新时代证券有限责任公司
 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层

1501
 办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层
 1501
 法定代表人:刘汝军
 开放式基金咨询电话:400-698-9898
 开放式基金业务传真:010-83561094
 联系人:孙艳
 联系电话:010-83561149
 网址:www.xsdzq.cn
 69)信达证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
 法定代表人:张志刚
 联系人:唐静
 联系电话:010-63081000
 传真:010-63080978
 客服电话:400-800-8899
 公司网址:www.cindasc.com
 70)兴业证券股份有限公司
 注册地址:福州市湖东路268号
 办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层

层
 法定代表人:兰荣
 客服电话:95562
 业务联系电话:0591-38162212
 公司网址:http://www.xyzzq.com.cn/xyzz/index.html
 71)中国银河证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
 办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
 法定代表人:陈有安
 开放式基金咨询电话:4008-888-888
 开放式基金业务传真:010-66568990
 联系人:田薇
 联系电话:010-66569430
 网址:www.chinastock.com.cn
 72)招商证券股份有限公司
 注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
 法定代表人:宫少林
 电话:0755-82943666
 传真:0755-82943636
 联系人:林生迎
 客户服务电话:95565,4008881111
 公司网址:www.newone.com.cn
 73)中航证券有限公司
 注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼
 法定代表人:王宜四
 电话:0791-86768681
 联系人:戴露
 客户服务热线:400-8866-567
 公司网址:www.avicsec.com
 74)中国国际金融有限公司
 注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

层
 办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
 层
 法定代表人:金立群
 电话:010-65051166
 传真:010-85679535
 公司网址:http://www.cicc.com.cn
 75)中天证券有限责任公司
 注册地址:沈阳市和平区区光荣街23甲
 办公地址:沈阳市和平区南五马路121号万丽城晶座4楼中天证券经纪营业部
 法定代表人:马功勋
 联系人:袁勃松
 联系电话:024-23280942
 客服电话:4006180315
 公司网站:www.stockren.com
 联系人:袁勃松
 76)中国中投证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01,02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23单元
 办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04,18层至21层
 法定代表人:刘锐
 电话:0755-82023442
 传真:0755-82026539
 网址:www.china-invscn.com
 客服电话:400-600-8008,95532
 77)中信建投证券股份有限公司
 注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
 办公地址:北京市朝阳区门内大街186号
 法定代表人姓名:王常青
 基金业务对外联系人:权辉
 联系电话:400-8888-108
 联系传真:010-65182261
 公司网址:www.csc.com.cn
 客服电话:400-8898-108
 78)中信证券(浙江)有限责任公司
 注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19,20层
 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19,20层

主楼19,20层
 法定代表人:沈强
 联系人:王滢滢
 联系电话:95548
 公司网站:www.bigsun.com.cn
 79)中信证券(山东)有限责任公司
 注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层(266061)
 办公地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层(266061)
 法定代表人:杨宝林基金业务联系人:吴志超
 电话:0532-85022326
 传真:0532-85022605
 客户服务电话:95548
 公司网址:www.citicscsd.com
 80)中信证券股份有限公司
 注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
 传真:010-60833739
 联系人:顾凌波
 公司网址:www.cs.citic.com
 81)天相投资顾问有限公司
 注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701邮编:100032
 办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505邮编:100088
 法定代表人:林义相
 联系电话:010-66045152
 客服电话:010-66045678
 传真:010-66045518
 天相投顾网站:http://www.txsec.com
 天相基金网站:www.jim.com.cn
 82)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
 注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006

公司地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
 公司电话:(010)58153000
 订购热线:4009-945-899
 客服中心:0755-85398099
 客服热线:0755-85394677
 新兰德网站:http://www.new-rand.cn/
 83)和讯信息科技有限公司
 注册地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
 办公地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
 法定代表人:王利
 客服电话:400-920-0022
 联系人:周殊
 电话:021-20835789
 传真:021-20835895
 网址:litaike.hexun.com
 84)厦门市鑫鼎盛证券投资服务有限公司
 注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
 法定代表人:林松
 联系人:高雷
 电话:0592-3122719
 传真:0592-8060771
 客户服务电话:400-6980-777
 网址:www.dkhs.com
 85)深圳众禄基金销售有限公司
 注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
 办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
 法定代表人:薛峰
 联系电话:0755-33227950
 客服电话:4006-788-887
 传真:0755-82080798
 联系人:董彩屏
 网址:www.zlfund.cn及www.jimw.com
 86)上海天天基金销售有限公司
 注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
 注册资本:人民币伍千万元
 法定代表人:其实
 电话:021-54509998
 传真:021-64385308
 87)上海好买基金销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
 办公地址:上海市浦东新区南汇118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
 法定代表人:杨文斌
 电话:021-58870011
 传真:021-68596919
 公司网站:http://www.howbuy.com/
 88)杭州数米基金销售有限公司
 注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
 法定代表人:陈柏青
 联系人:张裕
 电话:021-60897840
 传真:0571-26698533
 客服电话:4000-766-123
 网址:http://www.fund123.com/
 89)上海长量基金销售顾问有限公司
 注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
 办公地址:上海市浦东新区浦大道555号裕景国际B座16层
 层
 法定代表人:张跃伟
 联系人:单伟桢
 电话:021-20691832
 传真:021-20691861
 客服电话:400-089-1289
 公司网站:www.erichfund.com
 90)浙江同花顺基金销售有限公司
 注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
 办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
 邮编:310012
 联系人:胡蝶
 联系电话:0571-88911818
 传真:0571-88800423
 客服电话:4008-773-773
 公司网站:www.5ifund.com
 91)北京展恒基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区后沙峪镇顺安街6号
 办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号院2号楼A座41楼
 层
 法定代表人:闫振杰
 电话:010-62020088
 传真:010-62020888-8002
 92)上海利得基金销售有限公司
 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
 办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
 法定代表人:盛大
 电话:021-50583533-3006
 传真:021-50583633
 客服电话:400-005-6355
 网址:www.leadfund.com.cn
 93)中期时代基金销售有限公司(上海)有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
 办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
 法定代表人:路璐
 电话:010-65807865
 传真:010-65807868
 客服电话:951624008888160
 网址:www.ciccofund.com
 94)浙江金诚财富管理有限公司
 注册地址:西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼D区J801室
 办公地址:浙江杭州西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心D区801室
 法定代表人:陆彬彬
 联系人:邓秀明
 电话:0571-56028620
 传真:0571-56899710
 客户服务热线:400-068-0058
 公司网站:http://www.jincheng-fund.com/
 95)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层

1809
 法定代表人:沈伟彬
 公司网站:www.yixinfund.com
 服务热线:400-6099-200
 客服邮箱:service@yixinfund.com
 96)万银财富(北京)基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
 办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
 法定代表人:王翌
 电话:010-59393923
 传真:010-59393074
 客服电话:400-808-0069
 网址:www.wy-fund.com
 97)北京增财基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区南礼士路66号建威大厦1209室
 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
 电话:010-67000988
 传真:010-67000988-6000
 联系人:孙晋峰
 网站:www.zvcw.com
 客户服务热线:400-001-8811
 98)深圳腾元基金销售有限公司
 注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心406-407
 办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心406-407
 服务电话:4006877899
 联系电话:0755-33376522
 传真号码:0755-33065616
 客服邮箱:service@tenyuanfund.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基金,并及时公告。

(一)注册登记机构
 名称:汇添富基金管理股份有限公司
 住所:上海市浦东新区大沽路298号6幢638室
 办公地址:上海市富锦路99号震旦国际大楼22楼
 法定代表人:李文
 电话:(021)28932888
 传真:(021)28932998
 联系人:韩从谦
 (二)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:韩朝
 电话:(021)31358666
 传真:(021)31358600
 经办律师:吕红、黎明
 联系人:吕红
 (四)会计师事务所和经办会计师
 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
 首席合伙人:吴港平
 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大楼16层
 办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼安永大楼16层

邮政编码:100738
 公司电话:(010)58153000
 公司传真:(010)85188298
 盖章会计师:潘化波、汤波
 业务联系人:潘化波
 四、基金名称
 本基金名称:汇添富实业债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、基金的投资方向
 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、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款及协议存款),以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接投资于二级市场上允许上市交易的股票,也不参与一级市场新股申购。因持有可转换债券转股所得的股票,因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。
 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和金融市场运行趋势,自上而下决定类属资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,重点自下而上的深入挖掘价值被低估的实业债品种的券种。本基金采取的投资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
 不同类属的券种,由于受到不同的因素影响,在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各种利率的利差变化趋势,综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素,合理配置并动态调整不同类属债券的投资比例。
 2.普通债券投资策略
 (1)利率策略
 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,结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判,从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上,结合期限利差与凸度综合分析,制定出具体利率策略。
 具体而言,本基金将首先采用“自上而下”的研究方法,综合研究主要经济变量指标,分析宏观经济状况,建立经济前景的场景模拟,进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,对影响资金面的因素进行详细分析与研判,建立资金面的场景模拟。
 在此基础上,本基金将结合历史与经验数据,区分当前利率债收益率曲线的期限利差、曲率与券间利率所面临的风险分位,判断收益率曲线参数变动的程度与概率,对收益率曲线平移的方向,陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析,以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现向上平移的概率较大时,即市场利率将上升,本基金将降低组合久期以规避损失;如出现向下平移的概率较大时,则提高组合久期;如收益率曲线趋于陡峭时,则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上,利用蝶形策略获取超额收益。

(2)实业债信用策略
 实业债信用债收益率是与其具有相同期限的无风险收益率加上反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济环境的影响,信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用债券本身的信用变化的影响,因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化和基于本身信用变化的策略。
 1)基于实业债信用利差曲线变化的策略
 本基金将以下两方面分析信用利差的变化情况,并采取相应的投资策略:
 宏观经济环境对信用利差的影响:当宏观经济向好时,信用利差可能由于实业债主体经营能力改善而收窄;反之,信用利差可能扩大。本基金将依据宏观经济的变化情况,加大对信用利差收窄的债券的投资比例。
 市场供求关系对信用利差的影响:信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给,而政策的变化、其他类属资产的收益率等也将影响投资者对信用债券的需求,从而对信用利差产生影响。本基金将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素,在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。
 2)基于本身信用变化的策略
 本基金依据内部信用评级系统持续跟踪研究实业债债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用投资进行评估并及时发出及时反应。
 为了准确评估债主体的信用风险,本基金设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“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”(包括流动性支持能力、及债券担保增信)-“得到评分”的评级过程。其中,定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析,主要包括四个方面:盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究,它是对定量分析的结果补充,能够有强提高定量分析的准确性。

本基金内部的信用评级体系定位为即期评级,侧重于评级的准确性,从而为自身业务的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、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券本身信用变化带来的市场交易机会。
 3)个券选择策略
 本基金将根据信用债券市场的收益率水平,在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上,建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型,并通过这些模型进行估值,重点选择具备以下特征的信用债券:较高当期收益率、较高当期回购、预期信用质量将改善,以及价值尚未被市场充分发现的个券。
 3.可转换债券投资策略
 基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境等因素,本基金在一级、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,实现基金资产稳健增值的目的。

1.行业配置策略
 本基金将根据宏观经济走势、经济周期,以及阶段性市场投资主题的变化,综合考虑宏观调控目标、产业结构调整等因素,精选成长前景明确或受益政策扶持的行业内公司发行的可转换债券进行投资布局,另外,由于宏观经济所处时期和市场发展的阶段不同,不同行业的可转换债券也将表现出不同的风险收益特征。在投资复苏的时期,持有资源类行业的可转换债券将获得良好的投资收益;而在经济衰退时期,持有防御类非周期行业的可转换债券,将获得更加稳定的收益。
 2)个券选择策略
 本基金将运用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,精选具有投资价值可转换债券券,力争实现较高的投资收益。
 3)条款博弈策略
 本基金将深入分析公司基本面,包括经营状况和财务状况,预测其未来发展战略和融资需求,结合流动性、到期收益率、纯溢价率等因素,充分发掘这些条款给可转换债券带来的投资机会。
 4.中小企业私募债券投资策略
 中小企业将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。
 本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以列入A的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行分类,以便准确评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。
 本基金对中小企业私募债券的投资策略为持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。

(一)投资决策依据和投资程序
 1.投资决策依据
 (1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
 (2)国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响;
 (3)国家货币政策及债券市场政策;
 (4)商业银行的信贷支持;
 (5)信用评级市场的基本情况。
 2.投资决策程序
 本基金投资决策流程为:
 (1)宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走势,提交策略报告。
 (2)债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告。
 (3)信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。
 (4)数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。
 (5)在分析研究报告的基础上,基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。
 (6)投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。
 (7)如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选

合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。
 (8)集中交易室执行交易指令。
 (三)投资限制
 1.组合限制
 基金的投资组合应遵循以下限制:
 (1)本基金对债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的80%;其中对实业债的投资比例不低于债券类资产的80%,实业债指以生产制造和基础设施为主业的企业所发行的债券,包括公司债、企业债(含城投债)、可转换债券、可分离债券、短期融资券(不含金融企业短期融资券)、中期票据和中小企业私募债券;
 (2)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
 (3)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
 (4)本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;
 (5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
 (6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
 (7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%;
 (8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
 (9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
 (10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
 (11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
 (12)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
 (13)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;
 (14)本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的20%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的10%;
 (15)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。
 基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
 法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。
 2.禁止行为
 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
 (1)承销证券;
 (2)向他人贷款或者提供担保;
 (3)从事承担无限责任的投资;
 (4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
 (5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
 (6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
 (7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
 (8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
 法律法规及监管部门取消上述禁止性规定的,则本基金不受上述相关限制。

九、基金的业绩比较基准
 本基金的业绩比较基准为:中债综合指数。
 中债综合指数是中国全市场债券指数,以2001年12月31日为基期,基点为100点,并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的代表性,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成分债券包括国债、企业债、央行票据等所有主要债券种类。选择中债综合指数作为本基金固定收益类资产投资比较基准的依据的主要理由有:第一,该指数由中央国债登记结算公司编制,并在《中国债券网》(www.chinabond.com.cn)公开发布,具有较好的权威性和市场影响力;第二,该指数的样本覆盖面广,能够较好地反映债券市场的整体收益。
 如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称,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业绩比较基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征
 本基金为债券型品种,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型股票及股票型基金。
 十一、基金的投资组合报告
 基金管理人的董事会及董事保证本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。
 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015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。
 本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

投资组合报告			
1.1 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	712,414,146.01	96.46
其中:债券	712,414,146.01	96.46	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,915,701.68	1.61
7	其他资产	14,263,377.82	1.92
8	合计	738,533,224.49	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
注:本基金本报告期末未持有股票。			
1.3 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			
注:本基金本报告期末未持有股票。			
1.4 报告期末按债券品种和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	地方政府债	102,014,000.00	16.66
4	中期票据	102,014,000.00	16.66
5	企业债	323,309,577.01	52.80
6	中期融资券	210,473,000.00	34.37
7	可转债	61,068,000.00	9.94
8	同业存单	15,549,580.00	2.57
9	其他	-	-
10	合计	712,414,146.01	126.36

1.5 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债券投资明细			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	1440310	14国债10	500,000
2	011507004	15国债16	400,000
3	101569006	15广佛铁路MTN003	300,000
4	041554026	15国债06	300,000
5	041555013	15康盛债	300,000

1.6 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明细			
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。			
1.7 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贵金属投资明细			
注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。			
1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细			
注:本基金本报告期末未持有权证。			
1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明			
1.9.1 本期国债期货投资政策			
注:本基金报告期内未投资国债期货。			
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细			
注:报告期末本基金无国债期货持仓。			
1.9.3 本期国债期货投资评价			
注:本基金报告期内未投资国债期货。			

1.9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：报告期末本基金无国债期货持仓。

1.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注

1.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

1.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.10.3 其他资产构成