

中加丰享纯债债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

(2017年第1号)

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

重要提示

中加丰享纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2016]2139号文准予募集注册。本基金基金合同于2016年11月1日正式生效。

基金管理人承诺本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读本招募说明书,基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金的投资“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金管理状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

本基金投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当债使主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出手持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、分离交易可转债所分离出的纯债部分,中小企业私募债券、央行票据、同业存单、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款、定期存款)等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)。

本基金不投资股票或权证。本基金不投资于转换债券和可交换债券,但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的纯债部分。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券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投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的份额初始价值1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

本基金的业绩净值并不预示其未来表现。基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要将根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册,基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为即表明其对基金合同的承认和接受,并按照基金法、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金份额持有人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2017年5月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年03月31日。(财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:中加基金管理有限公司
注册地址:北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室
办公地址:北京市西城区南纬路35号
法定代表人:国冰竹

成立时间:2013年3月27日
电话:400-00-95626

注册资本:3亿元人民币

存续期限:持续经营

股权结构:
中加基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2013]247号文批准,由北京银行股份有限公司、加拿大丰业银行、北京有色金属研究总院共同发起设立,注册资本为3亿元人民币。目前的股权比例为:北京银行股份有限公司62%、加拿大丰业银行33%、北京有色金属研究总院5%。

基金管理情况:目前基金管理人旗下管理十三只基金,分别是中加货币市场基金(A/C)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金(A/C)、中加纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加分红灵活配置混合型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(A/C)。

(二)主要人员情况
基金管理人董事会成员
国冰竹,全国政协经济委员会副主任,北京银行董事长,中加基金管理有限公司董事长,享受国务院特殊津贴专家,经济学硕士,管学硕士,高级经济师,中央财经大学硕士研究生导师,客座教授,南京大学校级兼职教授,北京银行博士后科研工作站指导教师,中共第十七次全国代表大会代表,第十一届、第十二届全国政协委员,中共第十届北京市委委员,北京市人大常委会,中国企业家协会副会长,中国银行业协会副会长,中国金融学会常务理事。

夏英先生,2014年3月起担任公司总经理,英国伦敦大学伦敦商学院金融硕士学位,于1996年加入北京银行,历任办公室员工,办公室副主任,航天支行行长,阜营管行长,资金交易部副总经理。具有丰富的金融行业工作经验。现任中加基金管理公司总经理,投资决策委员会主席,产品开发委员会主任。

魏忠先生(John Zhong Wei),副总经理,特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)、加拿大投资经理(CIM);曾任项目经理,国冰竹先生,全国政协经济委员会副主任,北京银行董事长,中加基金管理有限公司董事长,享受国务院特殊津贴专家,经济学硕士,管学硕士,高级经济师,中央财经大学硕士研究生导师,客座教授,南京大学校级兼职教授,北京银行博士后科研工作站指导教师,中共第十七次全国代表大会代表,第十一届、第十二届全国政协委员,中共第十届北京市委委员,北京市人大常委会,中国企业家协会副会长,中国银行业协会副会长,中国金融学会常务理事。

刘向途先生,被誉为“稽查大王”,经济学硕士。曾任北京银行董秘会办公室证券事务组负责人,投资者关系经理,全程参与北京银行IPO及IPO融资,日常主要从事北京银行证券事务,投资者关系管理,投融资管理等工作,期间还从事过北京银行公司治理工作,此前,曾任职于北京银行清华支行工作,熟悉资本市场、股权投资管理及公司治理等相关业务;2013年5月加入中加基金管理有限公司,任投资研究部副总监(负责人)。自2016年5月1日起,担任公司督察长。

4. 基金的基本情况

杨宇俊先生,金融工程博士,北京银行博士后,具有多年债券市场投资研究经验。曾任北京银行总行资金交易部分析师,负责债券市场和货币市场的研究与投资工作,2013年加入中加基金,任专户投资经理,具备基金经理从业资格。现任中加安心保本混合型证券投资基金基金经理(2016年3月23日至今),中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今),中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年9月19日至今),中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19日至今),中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年1月1日至今),中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年1月11日至今),中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年6月11日至今)。

5. 投资决策委员会

投资决策委员会成员包括公司总经理夏英先生,副总经理魏忠先生,监察长刘向途先生,市场营销部副总裁希琳女士,基金经理刘沛先生,张旭先生,杨宇俊先生,廉晓婷女士,投资研究员李继民先生,监察稽核部总监助理王雯女士。

6. 上述人员之间均不存在亲属关系。

(三)基金管理人的职责

根据基金法、《运作办法》及其他法律、法规的规定,基金管理人应履行以下职责:

1. 依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2. 办理基金备案手续;

3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6. 制定季度、半年度和年度基金报告;

7. 计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8. 办理与基金财产管理业务活动相关的信息披露事项;

9. 按照规定召集基金份额持有人大会;

10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11. 以基金管理人名义,代表基金份额持有人行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12. 有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1. 本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2. 本基金管理人不从事违反《中华人民共和国证券法》(以下简称“证券法”)的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反“证券法”的行为的发生。

3. 本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事内幕交易基金,承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资;

(6) 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;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

4. 本基金管理人将加强人员管理,强化职业道德,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用,勤勉尽责,不从事以下行为:

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向基金份额持有人以个人名义承兑或者承担损失;

(5) 侵占、挪用基金财产;

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动;

(7) 玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8) 其他法律、行政法规和中国证监会禁止的行为。

5. 基金经理定期报告

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

(2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三人谋取利益。

(3) 不泄密因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动;

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(五)基金管理人的内部控制制度

1. 内部控制的原则:

(1) 全面原则:内部控制应覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节,并普遍适用于公司每一位员工;

(2) 独立性原则:公司对业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位,并在相关部门建立防火墙;公司设立独立的风险管理部和合规监察稽核部,保持高度的独立性和客观性,分别履行风险管理部和合规监察稽核部的职责,协助和配合监察长负责对公司各项内部控制工作进行监督检查;

(3) 审慎性原则:内部控制的核心是有效防范各种风险,任何制度的建立都要考虑风险,审慎经营为出发点;

(4) 有效性原则:公司内部管理制度具有高度的权威性,是所有人员严格遵守的行动指南,执行内部控制制度不能有任何例外,任何人不能超越权限或违反规章制度;

(5) 及时性原则:内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合,充分利用电脑网络,建立电脑预警系统,保证监控的及时性;

(6) 适应性原则:内部控制制度应具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营环境的变化而不断调整和优化;

(7) 定量与定性相结合的原则:建立完善内部控制指标体系,使内部控制更具客观性和操作性;

(8) 成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果;

(9) 相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡;

2. 内部控制制度及措施:

本行已建立完善的内部控制制度。内部控制贯穿于公司规章制度的决策、执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到基金份额托管各组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点,各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内部控制措施包括:培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险管理理念,增强浓厚的内控文化氛围,使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度,明确岗位职责和各项操作规程,员工职业道德规范、业务数据备份和保密制度等在内的各项管理制度;建立严格完善的资产隔离和资产保管制度,托管资产与托管人财产及不同时期的基金财产混同;中信建投稳盈保本基金、中信建投稳健收益基金、华富恒裕分级债券基金、华富丰盈纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年9月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年1月1日至今)、中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年1月11日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年6月11日至今)。

3. 内部控制制度及措施:

本行已建立完善的内部控制制度。内部控制贯穿于公司规章制度的决策、执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到基金份额托管各组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点,各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内部控制措施包括:培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险管理理念,增强浓厚的内控文化氛围,使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度,明确岗位职责和各项操作规程,员工职业道德规范、业务数据备份和保密制度等在内的各项管理制度;建立严格完善的资产隔离和资产保管制度,托管资产与托管人财产及不同时期的基金财产混同;中信建投稳盈保本基金、中信建投稳健收益基金、华富恒裕分级债券基金、华富丰盈纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年9月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年1月1日至今)、中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年1月11日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年6月11日至今)。

4. 内部控制制度及措施:

本行已建立完善的内部控制制度。内部控制贯穿于公司规章制度的决策、执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到基金份额托管各组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点,各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内部控制措施包括:培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险管理理念,增强浓厚的内控文化氛围,使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度,明确岗位职责和各项操作规程,员工职业道德规范、业务数据备份和保密制度等在内的各项管理制度;建立严格完善的资产隔离和资产保管制度,托管资产与托管人财产及不同时期的基金财产混同;中信建投稳盈保本基金、中信建投稳健收益基金、华富恒裕分级债券基金、华富丰盈纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年9月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年1月1日至今)、中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年1月11日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年6月11日至今)。

5. 内部控制制度及措施:

本行已建立完善的内部控制制度。内部控制贯穿于公司规章制度的决策、执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到基金份额托管各组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点,各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内部控制措施包括:培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险管理理念,增强浓厚的内控文化氛围,使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度,明确岗位职责和各项操作规程,员工职业道德规范、业务数据备份和保密制度等在内的各项管理制度;建立严格完善的资产隔离和资产保管制度,托管资产与托管人财产及不同时期的基金财产混同;中信建投稳盈保本基金、中信建投稳健收益基金、华富恒裕分级债券基金、华富丰盈纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年9月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年1月1日至今)、中加丰享纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年1月11日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金基金经理(2017年6月11日至今)。

6. 内部控制制度及措施:

本行已建立完善的内部控制制度。内部控制贯穿于公司规章制度的决策、执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到基金份额托管各组织结构、岗位及人员。内部控制