

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”)经中国证监会基金部备案于2016年9月20日获准许可【2016】2139号文准予募集注册。本基金基金合同于2016年11月11日正式生效。

基金管理人保证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,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投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营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。当发生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所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来较大负面影响和损失。

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、中期票据、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)等以及法律法规和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)。

本基金不买入股票或权证。本基金不投资可转换债券和可交换债券,但可以通过投资分离交易可转债上市部分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%。

本基金基金份额初始面值100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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其它基金业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要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。基金合同约定了基金份额持有人之间的权利义务,基金份额持有人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并依照《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。基金投资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及招募说明书全文。

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:北京市西城区仁和镇顺泽大街65号317室
办公地址:北京市西城区南纬路35号
法定代表人:闫冰竹
成立时间:2013年3月27日
电话:400-00-96526
注册资本:3.12亿元人民币
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3.12亿元人民币。目前的股权结构为: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%。

基金管理机构: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)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加中债1-3年期国债指数证券投资基金(A/C)、中加中债3-5年期国债指数证券投资基金(A/C)、中加丰沛纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加丰盈纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金。

(二)主要人员情况
1.基金管理人董事会成员
闫冰竹,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,管理学硕士,高级经济师,中央财经大学硕士研究生导师、客座教授,南京大学教授兼职教授,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,中共第十八届北京市委委员,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、中国企联会副会长、中国青年企业家协会副会长、北京市金融学会副会长、中国金融学会常务理事。
金融从业40余年,曾在中国人民银行、中国工商银行北京分行工作和担任其分支机构党委书记、主任,营业部党委书记、总经理。1996年组建北京银行并担任党组书记、主任,2002年至今担任董事长、曾获“全国五一劳动奖章”、“中国先进工作者”、“中国十大金融人物”、“十大中华经济英才”、“北京市先进年度人物”、“影响百姓生活的‘十大企业’”、“中国十大金融新锐人物”、“中国改革贡献人物”、“十年银行家”、“影响中国年度金融人物”、“2016中国经济年度人物特别大奖”等荣誉。 编著《商业银行价值管理》、《破解小金融机构面临现实风险》、《主责!转型时期商业银行发展路径与实践》、《商业银行风险管理理论与实务》等书籍,发表专业论文文章100余篇。

冯丽华女士,副董事长,管理学硕士。2013年3月加入公司董事会。自1985年始,冯女士历任工商银行东城支行计划科副科长、北京市计划委员会金融处正科级调研员、北京银行资金计划部、公司金融部、个人银行部、财富管理部等部门总经理,现任北京银行股份有限公司副行长兼零售业务总监。

杨书剑先生,董事,经济学博士,高级经济师。2013年3月加入公司董事会。杨先生现任职于北京银行股份有限公司,于2014年8月起担任副行长,2007年8月至今年任董事兼北京,2014年7月至今兼任石家庄分行主任,2005年8月至2007年7月任北京银行总行办公室副主任(主持工作),2004年2月至2005年2月担任学院路支行行长,2002年6月至2004年1月担任人事管理副总监,2000年5月至2002年4月担任办公室副主任,1997年7月至2000年4月担任业务发展银行公司业务组长。杨先生于1991年获吉林大学经济学学士学位,1994年获吉林大学经济学硕士学位,1997年获中央财经大学经济学博士学位。

Peter Stan先生,董事,2017年3月加入公司董事会。现任国际财富管理高级副总裁,负责丰业银行在加拿大境外所有财富管理、保险、养老金及资产管理业务。Peter Stan先生在境外所有银行工作了17年,在金融、财富管理、全球投资银行和股权投资市场等业务领域都担任过高级管理人员。他的主要工作内容包括Baycrest基金业务,串联联合犹太大乐市内圈层组织。Peter Stan先生是特許會計師和特許专业会计师,持有多伦多大学特等管理学院的工商管理硕士(MBA)学位。

周美思女士,董事,2013年9月加入公司董事会。毕业于香港理工大学,拥有加拿大财务策划协会和财务策划师协会颁发的财务策划证书,同时也是加拿大银行家协会会员。周女士拥有25年金融工作经历,擅长于风险管理,负责投资、基金及经纪业务。在她丰富的职业生涯中,推出了领先的区域和全球投资基金,建立过基金超市,并在日本领导第一美元资产管理基金,也曾负责香港、新加坡及日本跨国家金融机构担任董事职务。目前,周女士任职加拿大丰业银行亚太区财富管理业务副总裁,负责亚太地区全面财富管理策略的开发和执行,领导亚洲财富管理办公室,包括理念构思与设计、市场评估、产品开发及管理以及合规、经营合规性和风险管理。

张少明先生,董事,工学博士。2013年3月加入公司董事会。自1984年始,张先生先后在北京有色金属研究总院(以下简称“研研总院”1208室、复合材料研究所、开发经营处、投资经营部等部门担任副主任、常务副主任、处长、主任等职务,2001年起担任研研总院副院长,2006年起担任研研总院党委书记、副院长,2009年起任研研总院院长至今。

杨运杰先生,经济学博士、教授、博士生导师,2013年3月起担任公司独立董事。自1986年始,张先生先后在河北林学院、中央财经大学担任经济学的教学工作,并先后担任系副主任、研究生部常务副主任、学院院长等职务,期间还在深圳经济特区证券北京资产管理总部担任经理助理。现任中央财经大学研究生院常务副院长、教授、博士生导师。

吴小英女士,独立董事,研究生,2013年3月担任公司独立董事。自1985年起,吴女士先后在中国人民银行股份有限公司、中国银行中苑宾馆、中国民族国际信托投资公司、中国民族证券有限责任公司工作,并先后担任副科长、人事主管、商贸部总经理、纪委副书记等职务。

杨文先生,独立董事,工商管理硕士,2013年3月起担任公司独立董事。自1993年始,杨先生先后在中国航空技术进出口总公司担任分析员、在法国里昂普华永道会计师事务所担任经理,在WH Harper Group(中经集团)担任经理,在中国华创网担任经理,在鑫鑫创投投资公司担任合伙人,在北京华创先锋科技有限公司担任总经理并在美国纽约证券交易所在纽约代表机构担任首席代表等职务。

2.基金管理人监事会成员
高红女士,监事。现任北京银行股份有限公司资产管理部公司银行部总经理。高女士自1994年起,先后担任湖北国际信托投资公司营业部总经理、湖北三峡证券有限责任公司总经营部总经理、黑龙江佳木斯证券分公司总经理、北京证券有限责任公司总经营部总监、西北证券有限公司董事长助理兼合规部总经理等职务,拥有丰富的金融行业工作和管理经验。2008年加入北京银行,先后任职于总行公司银行总行、北京管理部大客户二部及公司银行部。

希琳(Shirley She)女士,监事,厦门大学大学学士、加拿大达尔豪西大学(Dalhousie University)工商管理硕士MBA,拥有CIMA、CIPM、COP等专业资格证书,并长期在国际知名资产管理机构从事投资工作,在境外证券投资及产品研发方面有丰富的经验。2000年4月至2013年7月历任加拿大丰业银行丰业证券投资高级经理、业务资产管理高级投资经理,2013年7月至2013年12月担任加拿大丰业银行中国投资产品总监。2013年12月至今担任加拿大市场营销部副总监。

边宏伟先生,职工监事,上海同济大学大学学士、美国约翰霍普金斯大学国际金融学硕士,掌握扎实的金融及财务管理理论知识,具有丰富的经济金融及跨境金融管理工作经验。边宏伟先生自1983年至1999年任职于中国日报社,1990年至2003年任职于世界银行及国际货币基金组织

织,2004年至2013年于北京银行股份有限公司零售银行部副总经理;2013年3月加入中加基金管理有限公司,现任市场营销部总监。

王雯雯女士,职工监事,经济学硕士。曾任职于北京银行,从事风险管理等相关业务;2013年5月加入中加基金管理有限公司,任监察稽核部总监助理。

3.总经理及其他高级管理人员
闫冰竹先生,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,管理学硕士,高级经济师,中央财经大学硕士研究生导师、客座教授,南京大学教授兼职教授,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,中共第十八届北京市委委员,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、中国企联会副会长、中国青年企业家协会副会长、北京市金融学会副会长、中国金融学会常务理事。
夏英先生,2014年3月起任公司总经理,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,阜裕营销银行行长,资金交易部副总经理。具有丰富的金融工作经历。现任中加基金管理有限公司总经理、投资决策委员会主任、产品开发委员会主席。

魏忠先生(John Zhong Wei),副总经理,特许金融分析师(CFA)、金融风险管理经理(FRM)、加拿大投资经理(CIM);曾任职于道富克林德普纳姆投资公司(多伦多、加拿大),大明基金(Dynamic Funds,多伦多、加拿大)及丰业银行全球资产管理(多伦多、加拿大);自2014年3月19日正式担任公司副总经理一职,并主管风险管理业务。
刘向途先生,督察长,经济学硕士。曾任北京银行董事会办公室证券事务组负责人、投资者关系室经理,全程参与北京银行IPO及再融资工作,日常主要从事北京银行证券事务、投资者关系管理、融资融券等工作,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大学支行、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17日起,担任公司督察长。

4.基金基金经理
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,负责债券市场和利率的研究与研究工作。2013年加入中加基金,任专户投资经理,具备基金从业资格。现任中加加拿大混合型基金证券投资基金基金经理(2016年3月23日至今)、中加丰沛纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年6月17日至今)、中加丰尚纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年8月19日至今)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年12月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年11月2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(2016年11月11日至今)、中加丰裕纯债债券型证券投资基金基金经理(2016年11月28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,督察长刘向途先生,市场营销部副总监希琳女士,基金经理闫冰竹先生、张旭先生、杨宇俊先生、陈晓娟女士,投资研究部研究员李继民先生,监察稽核部总监助理王雯雯女士。
(三)基金管理人的人员
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.依法募集资金,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.编制季度、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有关的信息披露事项;
- 9.按照投资运作基金资产净值,编制基金资产净值公告;
- 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利益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它职责。

(四)基金管理人承诺
1.基金管理人将根据基金合同的约定,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.基金管理人不会从事违反《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.基金管理人不会从事违反《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)从事使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)从事内幕交易、基金托管人交易;
- (6)向内幕交易、操纵证券市场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.基金管理人将加强人力资源管理,强化职业操守,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,不得从事以下行为:
- (1)将其固有财产或者他人财产财产置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)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (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、暗示他人从事相关的交易活动;
- (7)玩忽职守,不按照规定履行职责;
- (8)其它法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5.基金经营承诺
(1)依照有关法律、法规和基金合同的约定,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、受雇人或其他第三人谋取利益。
(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者暗示、暗示他人从事相关的交易活动。

(4)不以任何形式为其他组织或个人进行证券投资。
(五)基金管理人内部控制制度

- 1.内部控制的原则
本基金管理人内部控制遵循以下原则:
(1)全面性原则:内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务流程环节,并普遍适用于公司每一位员工;
- (2)独立性原则:公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位,并在相关机构建立防火墙,公司设立独立的风险管理部和监察稽核部,保持高度的独立性和权威性,分别履行风险管理和合规监察职责,并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查;
- (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以防范风险、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,是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有例外,任何人不得拥有超越制度和违反制度的权力;
- (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相结合,充分利用电脑网络,建立电子监察预警系统,保证监督的及时性;
- (6)适时性原则:内部控制制度的制订应具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营业务等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的变化及时进行修改和完善;
- (7)定量与定性相结合的原则:建立完备内部控制指标体系,使内部控制更具客观性和操作性;
- (8)成本效益原则:公司运用科学合理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
公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定,按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则,建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。
(1)公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2)公司基本管理制度包括风险管理制、监察稽核制度、投资管理制、基金会计核算制、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变机制等。
(3)部门业务规章是公司在基本管理制度和内部控制大纲、各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度,并结合部门职责和业务运作的要求制定。
3.完备严密的内控制度体系

公司建立独立的内部控制体系,董事会层面设立督察长,管理层设立独立于其他业务部门的风险稽核部和风险管理部,通过风险管理制和监察稽核制两个层面构建建立、完整、相互制约、关注成本效益的内部控制监督体系,对公司内部控制和风险管理情况进行持续有效的监督和反馈,保障公司内部控制机制的科学落实。
风险管理方面由董事会下设的风险管理委员会制定风险管理政策,由管理层的风险控制委员会负责实施,由风险管理部专职负责和监督,公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施,全面把握风险,防范和风险管理责任落实到人,实现对风险的日常管理和过程管理,防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已发生的各种风险。

监察稽核工作在督察长的领导下严格实施,由监察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职责。通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估,监督公司及员工遵守国家法律法规和监管规定,对公司对外承诺性文件及内部控制管理制度,识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险,提出并完善公司内部合规制度,予以维护公司客户的合法权益。通过检查公司内部管理制度、资讯管理、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节,对

公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议,从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

4.基金管理人关于内部控制的声明
本公司确保建立内部控制系统,维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确,并承诺根据市场环境的变化和公司的发展不断完善风险管理内部控制制度。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况
本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司,基本信息如下:

名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
成立时间:1992年10月19日

经营范围:经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准,公司主营业务主要包括:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;同业拆借;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供融资租赁业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外汇兑换;国际结算;同业外汇拆借;外汇票据的承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;结汇、售汇;买卖和代理买卖国债以及外国的有价证券;自营外汇买卖;代客外汇买卖;资信调查、咨询、见证业务;离岸银行业务;证券投资基金托管业务;全国社会保障基金托管业务;经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式:股份有限公司
注册资本:216.18亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人:朱萍
联系电话:(021)61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于领先水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部,2005年更名为资产托管部,2013年更名为资产托管与养老金业务部,2016年进行组织架构优化调整,并更名为资产托管部,目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心(含合肥分中心)五个职能部门。

目前,上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募基金投资托管、私募股权投资托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

(二)主要人员情况
刘信义,男,1965年出生,硕士研究生,高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理,上海市金融办挂职任机构处处长,金融办副主任助理,上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监,上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

刘长江,男,1966年出生,硕士研究生,经济师。历任工商银行总行教育部主任科员,工商银行基金托管部综合管理处副处长、处长,上海浦东发展银行总行基金托管部总经理,上海浦东发展银行总行资产及投资管理总部资产管理部,企业年金部、期货结算部总经理,上海浦东发展银行公司及投资管理总部副经理兼综合基金部、企业年金部、期货结算部总经理,上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。现任上海浦东发展银行总行金融机构部、资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况
截止2016年12月31日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为1840.61亿元人民币,比去年同期增长85.40%。托管证券投资基金共七十四只,分为四国基金龙行行业精选基金、国泰金牛债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、银华添泰债券基金、长信利众债券基金(LOF)、华富保本灵活配置证券投资基金、中海安鑫保本基金、博时安丰18个月基金(LOF)、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富富利增强债券基金、中信建投信用债券基金、华富恒发分级债券基金、汇添富和聚安丰基金、工银目标收益一年定开债基金、北信瑞丰宜安货币基金、中海医药健康产业基金、国泰安保新益信用债基金、华国泰民安灵活配置混合基金、博时产业债纯债基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安生态环合基金、国联安鑫富混合基金、长盛创新优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、国联恒顺成长基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫益基金、国联安鑫悦基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活灵活混合基金、鑫元利债债券基金、国联安安稳保本基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华添势债券基金、华富鑫鑫灵活配置基金、富安达长盈保本基金、中银恒发纯债基金、国联安恒享纯债基金、长信利发债券基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛定期开放基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红策略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时发纯债基金、银河君信混合基金、鹏华兴悦定期开放基金、汇添富鑫保本混合基金、鹏华长盛顺颐混合基金、兴业元元一年定开债基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债基金、中信建投裕发定开债券基金、招商招信纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泽沛纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇丰一年定开债券基金、国联安鑫盛混合基金、汇添富汇添纯债基金、鹏华丰泰债券基金、南方宣利一年定开债基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞瑞灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰鑫利灵活配置混合基金、国联安鑫利混合基金、易方达瑞瑞混合基金、华福长丰一年定开基金、中银添泰货币基金、招商招祥纯债债券基金、汇添富瑞瑞灵活配置混合基金、汇添富源顺纯债基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元丰汇债券债券基金。

(四)基金托管人的内部控制制度
1.本行内部控制目标为:确保经营活动中严格遵守国家有关法律、法规和监管规则等规章制度和内部规章制度,形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行,保证基金财产的安全和完整,确保业务活动信息的真实、准确、完整,保护基金份额持有人的合法权益。

2.本行内部控制组织架构为:总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门,指导各业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险管理部是全行风险管理的主管部门,指导各业务部门开展资产托管业务的操作风险管理工作。总行资产托管部下设内部控制处,内控管理处是全行资产托管业务条线的内部控制管理实施机构,并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职责。

3.本行内部控制措施包括:总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门,指导各业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险管理部是全行风险管理的主管部门,指导各业务部门开展资产托管业务的操作风险管理工作。总行资产托管部下设内部控制处,内控管理处是全行资产托管业务条线的内部控制管理实施机构,并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职责。托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作,分别核算,对各类突发事件或故障,建立完备有效的应急预案,定期开展应急演练,建立重大事项报告制度。在基金运作中区分区域建立安全监控系统,利用录音、录像等手段采取双录控制,定期进行业务情况自查,内控稽核部门负责进行监控,通过专项/全面审计等稽核监督业务监控,排查发现风险。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

1.监督依据
托管人依国家有关法律法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。

- (1)《中华人民共和国证券法》;
- (2)《中华人民共和国证券投资基金法》;
- (3)《公开募集证券投资基金运作管理办法》;
- (4)《证券投资基金销售管理办法》;
- (5)《基金合同》、《基金托管协议》;
- (6)法律、法规、政府的其他规定。

三、监督内容

我根据基金合同及托管协议约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督,并及时提示基金管理人违规风险。
3.监督方法
(1)资产托管部设置监察监督岗位,配备相应的业务人员,在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督稽核,规范基金运作,维护基金投资的合法权益,不受任何外界力量的干预;
(2)在日常运作中,凡可能涉及基金违规的事项,由核算监督岗通过托管业务的自动风控程序进行监督,实现系统的自动跟踪和监督;并定期向管理人提供书面报告,投资稽核岗,向管理人提供的相关报告等,采取人工监督的方法。

4.监督稽核的处理方式
(1)基金托管人对基金管理人的投资运作进行监督结果,采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等。

(2)若基金托管人发现基金管理人违规事项,以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人,指明违规事项,明确纠正期限。在规定期限内基金管理人再对基金管理人违规事项进行整改,如果基金管理人无视违规事项有重大违规行为,将基金管理人立即报告中国证监会,并同时通知基金管理人限期纠正;

(3)针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查,应及时提供有关情况和资料。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
名称:中加基金管理有限公司
办公地址:北京市西城区南纬路35号
注册地址:北京市西城区仁和镇顺泽大街65号317室
法定代表人:闫冰竹
全国统一客户服务热线:400-00-96526

传真:010-83197627

联系人:王悦

公司网站:www.bobnas.com

2.基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时履行公告义务。

(二)登记机构
名称:中加基金管理有限公司
注册地址:北京市西城区仁和镇顺泽大街65号317室
办公地址:北京市西城区南纬路35号
法定代表人:闫冰竹
全国统一客户服务热线:400-00-96526

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通志律师事务所
住所: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:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖华

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京长安大街1号东方广场东2座办公楼8层
办公地址:中国北京长安街1号东方广场东2座办公楼8层
法定代表人:邹俊
经办注册会计师:李娜
电话:010-8508 7929
传真:010-8518 5111
联系人:曹哲铭

4.基金名称
基金名称:中加丰享纯债债券型证券投资基金

基金类型:契约性开放式基金

六、投资目标
力争在严格控制投资风险的前提下,长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

七、投资范围
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、中期票据、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)。

本基金不买入股票或权证。本基金不投资可转换债券和可交换债券,但可以通过投资分离交易可转债上市部分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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。

八、投资策略
本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、债券的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在信用债与利率债之间的配置比例。

1.久期策略
本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析,进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低利率变动对组合带来的影响。

收益团队将定期对利率期限结构进行预判,制定相应的久期目标,当预期市场利率水平将上升时,适当降低组合的久期;预期市场利率将下降时,适当提高组合的久期,以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提升债券组合收益率目的。

2.期限结构策略
通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类债券进行久期配置,当收益率曲线走势难以判断时,参考基准指数的样本久期期限组合久期,当收益曲线趋势超过基准收益、具体来看,又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

(1)骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,通过债券的收益率的下降,进而获得资本利得收益。

(2)子弹策略是指使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点,适用于收益率曲线较平时;杠铃策略是指使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端,适用于收益率曲线向下倾斜时下降更多的蝶式变动;梯式策略是指使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线,适用于收益率曲线水平移动。

3.类属配置策略
本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、利率水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究不同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场债券品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

4.信用债投资策略
信用债收益率等于基准收益率加信用利差,信用利差收益主要受两个方面影响,一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差走势;二是该信用水平本身信用变化。针对这两方面的因素,我们分别采用以下的分析策略:

(1)基于信用利差曲线变化策略:一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响,二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响,最后综合各种因素,分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定信用债配置总的及分行业投资比例。

(2)基于信用债信用变化策略:发行人信用发生变化后,我们将采用变化后信用等级所对应的信用利差曲线对公司、企业债定价,影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面,以确定企业主体债的实际信用状况,而进行投资。

5.杠杆投资策略
本基金将在考虑债券投资的风险收益情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。

6.资产支持证券的投资
资产支持证券的投资受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的结构及质量、提前偿还率及兑付附加条款等多种因素的影响。本基金将在对基金资产支持证券、市场流动性及信用评级的基础上,结合与国债、企业债等债券品种的相对价值比较,审慎投资资产支持证券类资产。