

# 农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金招募说明书

(2017年第2号更新)摘要

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
重要提示  
本基金的募集申请经中国证监会2016年7月22日证监许可【2016】1670号文注册。

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券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。中国证监会对本基金募集申请的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。  
本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持份额享受基金的收益,但同时也承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人及基金在管理实施过程中产生的基金管理人风险,其基金是特定管理下。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,本基金为定期开放基金,即当单个开放日基金份额的净赎回申请超过前一日全部基金份额的百分之二十时,投资人将无法及时赎回持有的全部基金份额。本基金为债券型基金,属于中低风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。投资者有投资前认购(申购)基金前应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、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。本基金过往业绩不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

基金的投资价值并不预示其未来表现。  
本基金托管人已经对本招募说明书中涉及与托管业务相关的更新信息进行了复核、审查。招募说明书(更新)所载内容截止日为2017年11月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人  
(一)公司概况  
名称:农银汇理基金管理有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层  
法定代表人:于进  
成立日期:2008年3月18日  
批准设立机关:中国证券监督管理委员会  
批准设立文号:证监许可【2008】307号  
组织形式:有限责任公司  
注册资本:贰亿零元人民币  
存续期限:持续经营  
联系人:崔爱东  
联系电话:021-61095588  
股权结构:

股东	出资额(元)	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中银资本控股有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

(二)主要人员情况  
1.董事会成员:  
于进先生,董事长  
金融学硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作,历任信息部副处长、处长、人事处处长、副总经理,电子银行部总经理,科技与产品管理局局长,2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。  
Bernard Carayon先生:副董事长  
经济学博士。1978年起历任法国农业信贷银行集团督察员、中央风控控制部主管,东方汇理银行和东方汇理投资管理有限公司主管,东方汇理资产管理公司管理委员会成员。现任东方汇理资产管理公司副总裁。

许金超先生:董事  
高级经济师,经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作,历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长,中国农业银行山西分行党委副书记,中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长,中国农业银行采购管理总部经理,中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

钟小锋先生:董事  
政治学博士。1996年5月进入法国东方汇理银行工作,先后在法国东方汇理银行(巴黎)、东方汇理银行广州分公司、香港分公司、北京代表处工作。2006年12月起任东方汇理银行北京分公司董事总经理。2011年11月起任东方汇理资产管理香港有限公司北亚区副行政总裁。2012年9月起任东方汇理资产管理香港有限公司北亚区行政总裁。

蔡安辉先生:董事  
高级经济师、管理学博士学位。1999年10月起历任中国有稀土金属集团公司财务综合处财务副处长,历任中国铝业公司财务处处长,中国国际贸易有限公司董事,中铝国际工程有限公司财务总监会,贵阳铝镁设计研究院有限公司党委书记、副总经理,中铝财务有限责任公司董事、执行董事、总经理、工会主席,中铝财务控股有限公司执行董事。现任中铝资本控股有限公司董事长、总经理,中铝财务有限责任公司董事长、党委书记,中铝保险经纪(北京)股份有限公司和中铝融资租赁有限公司董事长。

华若鸣女士:董事  
高级工商管理硕士,高级经济师。1969年起在中国农业银行工作,先后任中国农业银行总行国际业务部副总经理、香港分行总经理,中国农业银行电子银行部副总经理。现任中国农业银行股份有限公司金融市场部总经理。

王小辛先生:独立董事  
经济学博士。曾任香港城市大学助理教授、世界银行顾问、联合国顾问、韩国首尔国立大学客座教授。现任复旦大学管理学院金融学教授,兼任香港大学商学院名誉教授和挪威管理学院兼职教授。

傅晓军先生:独立董事  
经济学博士,高级经济师。1973年起,任江苏省盐城汽车运输公司教师,江苏省人民政府研究中心科员。1990年3月起任中华财务咨询公司董事长、总经理。

徐信忠先生:独立董事  
金融学博士、教授。曾任英国Bank of England货币政策局金融经济学家;英国兰卡斯特大学管理学院金融学教授;北京大学光华管理学院副院长、金融学教授。现任中山大学岭南(大学)学院院长、金融学教授。

2.公司监事  
Jean-Yves Glain先生:监事  
硕士。1996年加入东方汇理资产管理公司,历任销售部负责人、市场部负责人、国际事务协调和销售部负责人、国际协调与支持部负责人。现任东方汇理资产管理公司总裁兼支持与业务发展部负责人。

杨静女士:监事  
美国管理会计师,金融工商管理硕士学位。2008年4月起历任雷博国际会计高级经理,瑞银证券股票资本市场部董事总经理助理,德意志银行(北京)总裁助理、战略经理。现任中铝资本控股有限公司投资管理部高级业务经理。

胡惠琳女士:监事  
工商管理硕士。2004年进入基金行业,先后就职于长信基金管理有限公司、富国基金管理有限公司。2007年参与农银汇理基金管理有限公司筹建工作,2008年3月公司成立后任市场部总经理。

徐华先生:监事  
工学学士。2004年起进入资产管理相关行业,先后就职于恒生电子股份有限公司。2007年加入农银汇理基金管理有限公司参与筹建工作,现任农银汇理基金管理有限公司信息技术部总经理。

杨晓敏女士:监事  
管理学学士。2008年加入农银汇理基金管理有限公司,现任综合管理部人力资源部经理。

3.公司高级管理人员  
于进先生:董事长  
金融学硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作,历任信息部副处长、处长、人事处处长、副总经理,电子银行部总经理,科技与产品管理局局长,2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。

许金超先生:总经理  
高级经济师,经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作,历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长,中国农业银行山西分行党委副书记,中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长,中国农业银行采购管理总部经理,中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

施卫先生:副总经理  
经济学硕士、金融理学硕士。1992年7月起任中国农业银行上海市浦东分行国际部经理、办公室主任、行长助理,2002年7月起任中国农业银行上海市分行公司业务部副总经理,2004年3月起任中国农业银行香港分行副总经理,2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监,2010年10月起任中国农业银行东京分行筹备组组长,2012年12月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

崔爱东先生:督察长  
高级工商管理硕士。1988年起先后在中国农业银行《中国城乡金融报》社、国际部、伦敦代表处、个人业务部、信用卡中心工作。2004年11月起参加农银汇理基金公司筹备工作。2006年3月起任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书,监察稽核部总经理,2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

4.基金管理人  
姚晓军先生:督察长  
高级工商管理硕士。1988年起先后在中国农业银行《中国城乡金融报》社、国际部、伦敦代表处、个人业务部、信用卡中心工作。2004年11月起参加农银汇理基金公司筹备工作。2006年3月起任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书,监察稽核部总经理,2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

姚晓军先生,经济学硕士。历任金元顺安基金管理有限公司固定收益部助理研究员、农银汇理基金管理有限公司固定收益部研究员。现任农银汇理信用添利债券型证券投资基金基金经理、农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金基金经理、农银汇理金安18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员  
本基金采取集体投资决策机制。  
投资决策委员会由下述委员组成:  
投资决策委员会主席许金超先生,现任农银汇理基金管理有限公司总经理;

投资决策委员会成员付娟女士,投资总监,农银汇理消费主题混合型证券投资基金基金经理、农银汇理中盘混合型证券投资基金基金经理;  
投资决策委员会成员史向明女士,投资副总监、固定收益部总经理,农银汇理恒久增利债券型证券投资基金基金经理、农银汇理增强收益债券型证券投资基金基金经理、农银汇理7天理财债券型证券投资基金基金经理、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;

投资决策委员会成员郭世凯先生,投资部总经理,农银汇理行业成长混合型证券投资基金基金经理、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金基金经理、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金基金经理、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金基金经理。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。  
(三)基金管理人职责  
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代为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.编制基金定期报告;  
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.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

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、中国证监会和基金合同规定的其他职责。  
(四)基金管理人的承诺  
1.基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违法违规行为的发生。  
2.基金管理人从事下列行为:  
(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)利用基金财产或者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,不按照规定履行职务;  
(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3.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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不正当利益;  
(3)不得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、基金投资计划等秘密;  
(4)不得以任何形式为其他组织或个人进行证券投资交易。

(五)基金管理人风险管理和内部控制体系  
1.风险管理体系  
本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、流动性风险、信用风险、投资风格风险、操作风险、管理风险、合规性风险以及其他风险。

风险控制是实现有效回报的一个重要基石。借鉴东方汇理在风险控制领域的成熟经验,公司建立了完善的风险控制制度和健全的风险控制流程。通过科学有效、层次明晰、权责统一、监管明确的四道风险控制防线,从组织制度上确保风险控制的有效性和权威性。

(1)第一道防线:员工自律、内控和互控  
直接与业务系统、资金、有价证券、重要空白凭证、业务印章等接触的岗位,必须实行双人负责的制度。属于单人单岗的业务,由其上級主管履行监督职责;对于有条件的岗位,实行定期轮岗制度。

(2)第二道防线:部门之间控制  
各部门应检查本部门的各类风险隐患,严格遵守业务操作规范,完善内控措施,并对本部门的风险事件承担直接责任。研究、投资、集中交易、运营等部门独立运作,以实现部门间权力制约和风险控制。

(3)第三道防线:风险控制部与其它各部门的互动合作  
各部门应及时将本部门发生的风险事件向风险控制部报告。风险控制人员在风险管理委员会的指导下协助各部门识别、评估风险和制定相应的防范措施,监督《风险控制制度》和流程的严格执行,以及定期对部门面临的风险进行评估和报告。

(4)第四道防线:监察稽核部定期和不定期的稽核审计以及风险管理委员会的监督  
1.内部控制体系  
(一)内部控制的原则  
1)健全性原则。内部控制应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。  
2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行。  
3)独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位的职责应当保持相对独立,基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。  
4)相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

5)成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经营效益,以合理的控制成本达到最佳的内控控制效果。  
(二)内部控制的主要内容  
1)控制环境  
董事会下设稽核及风险控制委员会,主要负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制,对公司内部稽核审计工作结果进行审查和监督并向董事会报告;董事会下设薪酬和人力资源部委员会,负责制订公司董事和高级管理人员的薪酬政策,起草对公司董事和高级管理人员的绩效评价计划,审核公司总体人员编制方案和新薪政策,负责审议员工的聘用和培训政策。

公司实行董事会领导下的总经理负责制,总经理主持总经理办公会,负责公司日常经营管理工作中的重要决策。公司设投资决策委员会、风险管理委员会和产品委员会,就基金投资、风险控制和产品设计等发表专业意见及建议,投资决策委员会是公司最高投资决策机构。

公司设立督察长,对董事会负责,主要负责对公司基金运作的合法合规情况、内部控制情况进行监督检查,发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

2)内部控制的制度体系  
公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司管理制度根据规范的程度划分为四个层面:第一个层面是公司章程;第二个层面是公司内部控制大纲,公司治理制度及公司基本管理制度,它是公司制定各项规章制度的基础和依据;第三个层面是部门及业务管理制度;第四个层面是公司各部门根据业务需要制定的各种规则、实施细则以及部门业务手册,它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序,每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制的方式、方法和执行情况进行持续的检查,并出具专项报告。

3)风险评估  
(一)董事会下属的稽核及风险控制委员会和督察长对公司内外部风险进行评估;  
(二)公司风险管理委员会负责对公司经营管理中的重大突发事件和重大危机情况进行评估,制定危机处理方案并监督实施;负责对投资决策和运作中的重大问题和重大事项进行风险评估;  
(三)各层级人员负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

4)内部控制活动  
为体现职责明确、相互制约的原则,公司根据基金业务管理的特点,设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线:  
A.建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责,各业务均制定详尽的操作流程,各岗位人员上岗前必须熟知已熟知并承诺遵守,在授权范围内承担各自职责;  
B.建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门及岗位之间建立重要业务处理环节传递和信息沟通制度,后续部门及岗位对前一部及岗位负有监督的责任;  
C.建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部独立于其他部门,对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

5)信息与沟通  
公司建立有效的信息交流途径,形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息汇报渠道。通过建立有效的信息交流渠道,保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,并及时传达达给上级人员进行处理。公司根据组织架构和授权制度,建立了清晰的信息报告系统。

6)内部控制监督  
内部监控由监事会、董事会稽核及风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会和监察稽核部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设

立了独立于各业务部门的监察稽核部履行内部稽核职能,检查、评价公司内部内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的风险,及时提出意见改进,促进公司内部管理制度有效执行。

3.基金管理人关于内部控制的声明  
(1)本基金管理人知照建立、实施和维护内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;  
(2)上述关于内部控制的披露真实、准确;  
(3)本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人  
(一)基金托管人情况  
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)  
公司法定英文名称: BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD  
法定代表人:牛锡明  
住所:上海市浦东新区银城中路188号  
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号  
邮政编码:200120  
注册时间:1987年6月30日  
注册资本:742.62亿元  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号  
联系人:陆志屹  
电话:021-965669

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2006年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年美国《银行家》杂志发布的全球千家大银行排名,交通银行一级资本位列第13位,较上年上升4位;根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第153位,较上年上升37位。

截至2017年9月30日,交通银行资产总额为人民币89367.90亿元。2017年1-9月,交通银行实现净利润归属母公司股东人民币644.19亿元。

交通银行有多年证券、托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有银行基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,基金职业道德素质过硬,是一支诚实守信、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况  
牛锡明先生,董事长、执行董事。  
牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事,2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长,2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系,获学士学位,1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业,获硕士学位,1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁。  
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经大学获硕士学位。

(三)基金托管业务经营情况  
截至2017年9月30日,交通银行共托管证券投资基金319只。此外,交通银行还托管了基金托管部客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QDII证券投资基金、ROFII证券投资基金、QDII证券投资基金和ODLP资金等产品。

三、相关服务机构  
(一)基金份额发售机构  
1.直销机构:  
名称:农银汇理基金管理有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层  
法定代表人:于进  
联系人:叶冲  
客户服务电话:4006895599,021-61095599  
联系电话:021-61096810  
网址:www.abcc-ca.com

2.代销机构:  
(1)上海天天基金销售有限公司  
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼  
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座(东方财富大厦)  
法定代表人:其实  
联系人:王超  
电话:021-54509888  
传真:021-64385308  
客服电话:400-1818-188  
网址:www.1234567.com.cn  
其它代销机构名称及其信息另行公告。

(二)登记机构  
农银汇理基金管理有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层  
法定代表人:于进  
电话:021-61095588  
传真:021-61095566  
联系人:徐华军  
客户服务电话:4006895599  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海锦泰律师事务所  
住所:上海市浦东新区256号华夏银行大厦1406室  
办公地址:上海市浦东新区256号华夏银行大厦1406室  
负责人:廖海  
联系电话:(021)511510298  
传真:(021)51150398  
联系人:刘佳  
经办律师:刘佳、徐华

(四)审计机构  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:李丹  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238878  
联系人:张勇  
经办注册会计师:汪豫、张勇

4.基金名称  
农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金  
5.基金类型  
契约型开放式  
6.基金的投资目标  
本基金在严格控制风险的基础上,力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供长期稳定的回报。

七、投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。(但须符合中国证监会相关规定)

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:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

八、投资策略  
本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪,基于对利率、信用等市场的分析和预测,综合运用久期配置策略、期限结构策略、类属配置策略、信用策略、杠杆放大策略、跨市场套利策略及资产支持证券投资策略等策略,力争实现基金资产的稳健增值。

1.久期配置策略  
本基金根据对宏观经济、货币政策等因素的分析,判断未来市场利率可能的变动方向,并在合理预期市场利率水平的基础上,在不同的市场环境下灵活调整组合的目标久期,提高债券投资收益。当前市场预期利率上升时,通过增加持有短期债券或增持浮动利率债券等方式降低组合久期,以降低组合持仓风险;在预期市场利率下降时,通过增持长期债券等方式提高组合久期,以充分分享债券价格上涨时的收益。

2.期限结构配置  
在确定组合久期后,针对收益率曲线形状特征确定合理的组合期限在确定组合久期后,针对收益率曲线形状特征确定合理的组合期限

结构,包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3.类属配置策略  
在宏观分析及久期、期限结构配置的基础上,本基金根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的配置比例。

4.信用策略  
本基金将充分利用公司研究力量并借鉴外部的信用评级结果,建立内部信用评级体系和信用类债券核心库。根据发债主体的经营状况和现金流变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,对收益率走势及其收益和信用进行判断。在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益的品种进行投资。

5.杠杆放大策略  
本基金可采用杠杆放大策略扩大收益,即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金,并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券,以期获取超额收益。

6.跨市场套利策略  
跨市场套利是根据不同债券市场间的运行规律和风险特性,构建和调整债券组合,提高投资收益,实现跨市场套利。

7.资产支持证券投资策略  
本基金将平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,对资产支持证券的利率风险、提前偿还率、资产池结构、资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,对收益率走势及其收益和信用进行判断。在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益的品种进行投资。

9.业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率  
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,指数样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。该指数涵盖了银行间和交易所债券市场,具有广泛的市场代表性,适合作为本基金的业绩比较基准。

若未来法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整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。

十一、风险收益特征  
本基金为债券型基金,属于中低风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金,低于股票型、混合型基金。

十一、投资组合报告  
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同约定,复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容。  
本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日。  
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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,875,402,500.00	97.39
	其中:债券	29,875,402,500.00	97.39
4	衍生金融资产	-	-
5	金融资产公允价值变动	-	-
6	买入返售金融资产	300,000,000.00	0.98
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,793,243.49	0.02
8	其他资产	522,099,807.36	1.70
9	合计	30,703,165,550.84	100.00

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。  
(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合  
本基金本报告期末持有沪港通投资股票。

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.报告期末按品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券。

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券种	24,142,836,000.00	79.89
2	央行票据	24,142,836,000.00	79.89
	其中:中期票据	24,142,836,000.00	79.89
4	企业债券	664,826,000.00	2.10
5	企业短期融资券	1,616,822,000.00	5.26
6	中期票据	1,629,826,000.00	5.31
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	1,842,070,000.00	6.00
9	其他	-	-
10	合计	29,875,402,500.00	97.34

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  
本基金本报告期末未持有股票。

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  
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序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

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  
本基金本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
(1)本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货。  
(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

10.投资组合报告附注  
(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。  
(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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	10,026,206.48
3	应收股利	-
4	应收利息	512,974,601.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	522,099,807.36

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的投资业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为2016年11月7日,基金业绩数据截至2017年9月30日。

一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016年11月7日至2017年9月30日)

基金名称: 华泰紫金中证500指数增强型证券投资基金

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年11月7日至2017年10月31日	-0.07%	0.07%	-2.30%	0.17%	2.23%	-0.10%
2017年1月1日至2017年9月30日	2.3000%	0.0200%	0.3600%	0.1700%	1.9400%	-0.1500%