建信稳定丰利债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2018年第1号

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
二〇一八年一月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2015年9月8日证监许可[2015]2081号文注册募集。本基金的基金合同于2015年12月8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，并经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

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，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

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他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本招募说明书所载内容截止日为2017年12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）。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
设立日期：2005年9月19日
法定代表人：许会斌
联系人：郭雅莉
电话：010-66228888
注册资本：人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：中国建设银行股份有限公司，65%；美国信安金融服务公司，25%；中国华电集团资本控股有限公司，10%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由6名监事组成，其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

许会斌先生，董事长，高级经济师，享受国务院特殊津贴，中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983年毕业于辽宁财经学院基建财务与信用专业，获学士学位。历任中国建设银行筹资储备部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，营业部主要负责人、总经理，个人银行业务部总经理，个人银行业务委员会副主任，个人金融部总经理，2006年5月起任中国建设银行河南省分行行长，2011年3月出任中国建设银行批发业务总监，2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生，董事，现任建信基金管理有限责任公司总裁。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安北亚地区总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院，获经济学学士学位，2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官，宏利金融全球副总裁，宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事，信安北亚地区副总裁。

郑树明先生，董事，现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理，新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

华淑蕊女士，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学，获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者，湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监，锦辉控股集团公司副总裁、锦辉精细化工有限公司总经理，吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD）。

李全先生，独立董事，现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院，1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理，博时基金管理有限公司副总经理，新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险（加拿大）有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

2、监事会成员

张军红先生，监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士研究生学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员；零售业务部主任科员；个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理；行长办公室秘书一处高级副经理级处秘书、秘书、高级经理；投资托管服务部总经理助理、副总经理；投资托管业务部副总经理；资产托管业务部副总经理。2017年3月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔斯以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士，监事，高级会计师，现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与战略研究部总经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所，中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理，中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理，中国华电集团财务有限公司财务部经理，中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

严冰女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业，获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司，历任人力资源管理专员、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）总经理，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010年毕业于香港中文大学，获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司内控合规部。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监兼信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系，获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部，中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长，建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

曲寅军先生，副总裁，硕士。1999年7月加入中国建设银行总行，历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员、重组改制办公室高级副经理、行长办公室高级副经理；2005年9月起就职于建信基金管理公司，历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官；2013年8月至2015年7月，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理。2015年8月6日起任我公司副总裁，2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理，2017年11月30日起兼任建信资本管理公司董事长。

张威威先生，副总裁，硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行，从事个人零售业务，2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部，从事证券基金销售业务，任高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，一直从事基金销售管理工作，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴曙明先生，副总裁，硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作；1999年7月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006年3月加入我公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长，2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士，副总裁，硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作；2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部，历任副主任科员、业务经理、高级经理助理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

5、本基金基金经理

黎颖芳女士，硕士。 2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院，同年进入大成基金管理公司，在金融工程部、规划发展部任职。2005年11月加入本公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理。2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2011年1月18日至2014年1月22日任建信保本混合型证券投资基金的基金经理；2012年11月15日起任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理；2014年12月2日起任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理；2015年12月8日起任建信稳定丰利债券型证券投资基金的基金经理；2016年6月1日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月8日起任建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月8日起任建信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月15日至2017年8月3日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理，2017年1月6日起建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

钟敏棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁女士，固定收益投资部总经理。

姚锦女士，权益投资部总经理。

许杰先生，权益投资部副总经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司
住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25 号、甲25 号中国光大中心
成立日期：1992年6月18日
批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号
组织形式：股份有限公司
注册资本：466.79095亿元人民币
法定代表人：唐双宁
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号
投资与托管业务部总经理：曾闻学
电话：（010）63636363
传真：（010）63639132
网址：www.cebbank.com

（二）基金托管部门及主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任IT蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司执行董事、党委委员，兼任中国光大银行执行董事、行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部总经理。

（三）证券投资基金托管情况

截至2017年9月30日，中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、工银瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金等共89只证券投资基金，托管基金资产规模2126.48亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

（1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人：许会斌
联系人：郭雅莉
电话：010-66228800

（2）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：www.ccbfund.cn。

2、代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：田国立
客服电话：95533
网址：www.ccb.com

（2）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：唐双宁
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com

（3）中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人：李庆萍
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

（4）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（5）交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（6）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

（7）渤海银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区马场道201-205号
办公地址：天津市河东区海河东路218号
法定代表人：李伏安
客服电话：95541
网址：www.cbhb.com.cn

（8）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
客户服务电话：400-678-8887
网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

（9）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
法定代表人：陈柏青
客户服务电话：400-076-6123
网址：www.fund123.cn

（10）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
法定代表人：杨文斌
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（11）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
法定代表人：其实
客户服务电话：400-181-8188
网址：www.1234567.com.cn

（12）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
客户服务电话：400-920-0022
网址：www.Licaike.com

（13）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
法定代表人：凌顺平
客户服务电话：400-877-3772
网址：www.5ifund.com

（14）北京晨视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人：蒋煜
客户服务电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com

（15）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
法定代表人：娄越
客户服务电话：400-786-8868
网址：www.chtfund.com

（16）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
法定代表人：张皞
客户服务电话：400-820-2819
网址：www.chinapnr.com

（17）北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人：梁洪军
客户服务电话：400-819-6665
网址：www.buyforyou.com.cn

（18）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人：汪静波
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（19）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：郭坚
客户服务电话：400-821-9031
网址：www.lufunds.com

（20）北京虹点基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人：胡伟
客户服务电话：400-618-0707
网址：www.hongdianfund.com

（21）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
客户服务电话：0755-83999913
网址：www.jinqianwo.cn

（22）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人：肖雯
客户服务热线：020-89629066
网址：www.yingmi.cn

（23）奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
法定代表人：TAN YIK KUAN
客户服务热线：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn

（24）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
客户服务热线：010-56282140
网址：www.hcjijin.com

（25）天津国美基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁东华
客户服务热线：400-111-0889
网址：www.gomefund.com

（26）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
客户服务热线：400-921-7755
网址：www.leadbank.com.cn

（27）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人：王廷富
客户服务热线：400-821-0203
网址：www.windmoney.com.cn

（28）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#
法定代表人：张彦
客户服务热线：400-166-1188
网址：www.jrj.com.cn

（29）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
法定代表人：袁顾明
客户服务热线：400-928-2266
网址：www.dtfunds.com

（30）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
地址：北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦A座1504/1505室。
法定代表人：张冠宇
客户服务热线：400-819-9868
网址：www.tdyhfund.com

（31）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客户服务热线：4000-618518400-817-5666010-
网址：danjuanapp.com

（32）上海长量基金销售投资顾问有限公司
法定代表人：张跃伟
地址：上海浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com

（33）华融证券股份有限公司
法定代表人：祝献忠
地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层
客服电话：95390
网址：www.hrsec.com.cn

（34）中信期货有限公司
地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层
法定代表人：张皓
客服电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金份额登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人：许会斌
联系人：郑文广
电话：010-66228888

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人：王丽
联系人：刘焕志
电话：010-52682888
传真：010-52682999
经办律师：刘焕志、孙艳利

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
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）23238800
联系人：沈兆杰
经办注册会计师：许康玮、陈熹

四、基金的名称

本基金名称：建信稳定丰利债券型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：债券型基金。

六、基金的投资目标

通过重点投资于债券投资组合，本基金在严格控制风险和追求基金资产稳定增长的基础上，力争为投资者创造较高的当期收入和总回报。

七、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、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等固定收益金融工具，股票、权证等权益类资产，以及经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的相关规定）。

本基金可持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，也可直接买入股票和权证。

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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，对权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

（一）大类资产配置策略

本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。

（二）债券投资策略

1、债券投资组合策略

本基金在综合分析宏观经济、货币政策的基础上，采用久期管理和信用风险管理相结合的投资策略。

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线形变预测、信用利差和信用风险管理、回购套利等组合管理手段进行日常管理。

（1）久期调整

本基金通过宏观经济及政策形势分析，对未来利率走势进行判断，进而确定组合整体久期和调整范围。

（2）收益率曲线形变预测

收益率曲线形状的变化将直接影响本基金组合中长、中、短期债券的搭配。本基金将结合收益率曲线变化的预测，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

（3）信用利差和信用风险管理

信用利差管理策略决定本基金资产在不同类属债券资产间的配置策略。本基金将结合不同信用等级债券在不同市场时期的利差变化及收益率曲线变化调整公司债、企业债、金融债、政府债之间的配置比例。

（4）回购套利

本基金将适时运用多种回购交易套利策略以增强静态组合的收益率。比如运用跨市场套利、回购与现券的套利、不同回购期限之间的套利进行相对低风险套利操作等。

2、个券选择策略

在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、隐含期权价值评估、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金重点关注的对象：

（1）利率预期策略下符合久期设定范围的债券；

（2）资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有较大改善的企业发行的债券；

（3）在信用评级等因素基本一致的前提下，高债息的债券；

（4）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；

（5）公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率和投资溢价率合理、有一定下行保护的可转债；

（6）在合理估值模型下，预期能获得较高风险-收益补偿且流动性较好的资产支持证券。

3、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

（三）股票投资策略

本基金股票投资采用行业配置与个股精选相结合的投资策略，并通过灵活的仓位控制等手段来避免市场中的系统风险。

在行业配置策略方面，本基金采取相对集中的配置策略，从定性分析和定量分析两个角度对行业进行考察。重点投资行业景气周期处于拐点或者行业景气度处于上升阶段的相关产业。

在个股精选策略方面，本基金奉行“价值与成长相结合”的选股原则，即选择具备价值性和成长性的股票进行投资。基金管理人通过绝对估值与相对估值，对股票的内在价值进行判断，并与当前股价进行比较，对股票的价值性作出判断。在价值维度，主要考察市盈率（P/E）、市净率（P/B）等指标。在成长维度，主要从未来12个月每股收益相对于目前每股收益的预期增长率、公司可持续增长率和主营业务增长率等指标对股票进行考察。

（四）权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

九、业绩比较基准

1、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债总财富（总值）指数收益率。

2、选择比较基准的理由

中债总财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中债总财富（总值）指数为掌握我国债券市场价格波动幅度和变动趋势、测算债券投资回报率水平提供了很好的依据。

如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20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。

本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

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	27,407,884.96	10.34
	其中：股票	27,407,884.96	10.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	230,535,172.80	86.95
	其中：债券	230,535,172.80	86.95
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	2,783,395.90	1.05
8	其他资产	4,412,676.93	1.66
9	合计	265,139,130.59	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,776,150.00	1.31
C	制造业	10,623,100.00	5.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,665,600.00	0.79
F	批发和零售业	648,000.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,234,719.00	0.58
J	金融业	7,280,450.00	3.44
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,761,365.96	1.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	418,500.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	27,407,884.96	12.95

以上行业分类以2017年09月30日的证监会行业分类标准为依据。

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期未投资港股通股票。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	80,000	2,200,000.00	1.04
2	601398	工商银行	350,000	2,100,000.00	0.99
3	300070	碧水源	104,996	1,890,977.96	0.89
4	000968	蓝焰控股	100,000	1,673,000.00	0.79
5	601988	中国银行	400,000	1,648,000.00	0.78
6	600352	浙江龙盛	140,000	1,436,400.00	0.68
7	600038	中直股份	30,000	1,311,300.00	0.62
8	601233	桐昆股份	70,000	1,201,200.00	0.57
9	000001	平安银行	105,000	1,166,550.00	0.55
10	601318	中国平安	20,000	1,083,200.00	0.51

4、报告期末按债券品种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	金融债券	2,285,050.00	1.08
	其中：政策性金融债	2,285,050.00	1.08
4	企业债券	45,104,500.00	21.31
5	企业短期融资券	90,360,000.00	42.69
6	中期票据	40,081,000.00	18.94
7	可转债（可交换债）	3,019,622.80	1.43
8	同业存单	-	-
9	其他	49,685,000.00	23.47
10	合计	230,535,172.80	108.92

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	130232	15新疆05	500,000	49,685,000.00	23.47
2	041664047	16徐工机械CP003	200,000	20,094,000.00	9.49
3	011754074	17鞍钢股SCP001	200,000	20,088,000.00	9.49
4	011764060	17云投SCP002	200,000	20,052,000.00	9.47
5	143076	17兵装01	200,000	19,912,000.00	9.41

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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）本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

（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投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

10、投资组合报告附注

（1）本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（2）基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	40,342.12
2	应收证券清算款	781,219.48
3	应收股利	-
4	应收利息	3,590,906.92
5	应收申购款	208.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,412,676.93

（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未存在流通受限的情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2017年9月30日。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

1、稳定丰利A

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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
2015年12月8日-2015年12月31日	0.30%	0.05%	1.51%	0