信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）摘要

2018年第1期

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
二〇一八年八月

重要提示

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金于2011年11月4日经中国证监会证监许可【2011】1750号文核准募集。根据相关法律法规,本基金基金合同已于2012年5月7日生效,基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》,信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同生效后3年期届满,信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金自动转换为上市开放式基金(LOF)后,基金名称为"信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)"。

2016年7月22日基金管理人经营管理委员会同意将"信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)"的基金名称变更为"信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)"。2016年12月5日至2016年12月23日17:00止,信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会讨论通过了信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)的转型议案,内容包括调整该基金的投资目标、投资范围、投资策略、估值方法以及按照相关法律法规及中国证监会的有关规定修订基金合同等,并更名为"信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)"。上述基金份额持有人大会决定事项已于2016年12月26日通过,并于2016年12月27日起《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》同时失效,信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)正式变更为信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),本基金当事人将按照《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》享有权利并承担义务。

基金管理人保证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变更注册,但中国证监会对本基金的变更注册,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。

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,基金管理人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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦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等。

本基金投资中小企业私募债券,中小企业私募债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。当发债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,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金是债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,长期风险收益特征高于货币市场基金,低于股票基金、混合基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书中与托管业务相关的更新信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年6月25日,所载财务数据和净值表现截至2018年3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:信达澳银基金管理有限公司
住所:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层
办公地址:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9层
邮政编码:518054
成立日期:2006年6月5日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字【2006】071号
法定代表人:于建伟
电话:0755-83172666
传真:0755-83199091
联系人:郑妍
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
组织形式:有限责任公司
注册资本:壹亿元
股本结构:信达证券股份有限公司出资5400万元,占公司总股本的54%;康联首域集团有限公司(Colonial First State Group Limited)出资4600万元,占公司总股本的46%
存续期间:持续经营

(二)主要人员情况

1、董事、监事、高级管理人员董事:

董事:

于帆先生,董事长,毕业于厦门大学法律系。1987年7月至1988年10月任化工部管理干部学院经济系法学教师,1988年10月至1999年6月任中国信达信托投资公司部门副总经理、部门总经理,1999年6月至2000年9月任中国信达资产管理公司债权管理部高级经理,2000年9月至2007年9月任宏源证券股份有限公司董事会秘书、副总经理,2007年9月至2011年10月任信达证券股份有限公司党委委员、董事会秘书、副总经理、常务副总经理,2011年10月至2013年8月任中国信达资产管理公司投融资业务部总经理,2013年8月至今任信达证券股份有限公司董事、总经理。2014年9月16日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事长。

施普敦(Michael Stapleton)先生,副董事长,澳大利亚墨尔本Monash大学经济学学士。1996年至1998年担任JP摩根投资管理有限公司(澳大利亚)机构客户经理,1998年加入康联首域投资有限公司机构业务开发部门,负责澳大利亚机构客户销售和关系管理,2002年加入首域投资国际(伦敦),历任机构销售总监、机构业务开发主管,2009年6月起担任首域投资有限公司(香港)亚洲及日本区域董事总经理。

于建伟先生,董事,中央财政金融学院金融专业学士,东北财经大学EMBA。30年证券从业经历,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989年至1996年在中国建设银行信托投资公司工作,历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人;1996年至2000年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理;2000年至2004年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理;2004年至2008年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理;2008年至2013年5月任世纪证券有限公司副总裁;2013年7月加入信达澳银基金管理有限公司,2013年8月9日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

潘广建先生,董事,英国伯明翰大学工商管理硕士,加拿大注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所稽核部、香港期货交易所监察部。1997年起历任山一证券分析员、香港证券及期货事务监察委员会助理经理、香港强制性公积金计划管理局经理、景顺长城基金管理公司财务总监、AXA国卫市场部助理总经理、银联信托有限公司市场及产品部主管。潘广建先生于2007年5月起任首域投资(香港)有限公司中国业务开发董事並于同年兼任信达澳银基金管理公司监事至2016年5月13日,自2016年5月14日起,潘广建先生兼任信达澳银基金管理公司董事。

孙志新先生,独立董事,山西财经学院财政金融学学士,高级经济师。历任中国建设银行总行人事教育部副处长,总行教育部主任,总行监察室主任,广东省分行党组副书记、副行长,广西区分行党委书记、行长,总行人力资源部总经理(党委组织部部长),总行个人业务管理委员会副主任,总行党校(高级研修院)常务副校长,总行人力资源部总经理(党委组织部部长),总行工会常务副主席,总行监事会监事,于2011年1月退休。

刘颂兴先生,独立董事,香港中文大学工商管理硕士。历任W.I.Carr(远东)有限公司投资分析师,霸菱国际资产管理有限公司投资分析师、投资经理,纽约摩根保信托公司Intl投资管理副经理,景顺亚洲有限公司投资董事,汇丰资产管理(香港)有限公司(2005年5月起改组为汇丰卓誉投资管理公司)股票董事,中银保诚资产管理有限公司投资董事,新鸿基地产有限公司企业策划总经理,中国平安资产管理(香港)有限公司高级副总裁兼股票投资董事,中国国际金融(香港)有限公司资产管理部执行董事,Seekers Advisors(香港)有限公司执行董事兼投资总监。2012年6月19日起担任广发资产管理(香港)有限公司董事总经理。

刘治海先生,独立董事,全国律师协会公司法专业委员会委员,北京市人大立法咨询专家,中国政法大学法学硕士,历任江苏省盐城市政法干校教师,首都经贸大学经济系讲师,自1993年2月起担任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。2015年5月8日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

执行监事:

郑妍女士,中国农业大学管理学硕士,现任监察稽核部总监。2007年5月加入信达澳银基金管理有限公司,历任客户服务部副总经理、监察稽核部副总经理、监察稽核总监助理。自2015年1月起兼任信达澳银基金管理有限公司职工监事。

高级管理人员:

于建伟先生,总经理,中央财政金融学院金融专业学士,东北财经大学EMBA。30年证券从业经历,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989年至1996年在中国建设银行信托投资公司工作,历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人;1996年至2000年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理;2000年至2004年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理;2004年至2008年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理;2008年至2013年5月任世纪证券有限公司副总裁;2013年7月加入信达澳银基金管理有限公司,2013年8月9日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

黄晖女士,督察长,中南财经大学经济学学士,加拿大Concordia University经济学硕士。21年证券、基金从业经历,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1999年起历任大成基金管理有限公司研究部分析师、市场部副总监、规划发展部副总监、机构理财部总监等职务,其间两次借调到中国证监会基金部工作,参与养老基金重组、首批开放式基金评审等工作。2000-2001年参与英国政府"中国金融人才培训计划"(FIST项目),任职于东方汇理证券公司(伦敦)。2005年8月加入信达澳银基金管理有限公司,任督察长兼董事会秘书。

于鹏先生,副总经理,中国人民大学经济学学士。24年证券、基金从业经历,具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。历任中国建设银行总行信托投资公司证券总部驻武汉证券交易中心交易员、计划财务部会计、深圳证券营业部计划财务部副经理、经理;中国信达信托投资公司北京证券营业部总经理助理兼计财部经理;宏源证券股份有限公司北京营业部副总经理、机构管理总部业务监控部经理兼清算中心经理、资金财务总部副总经理、资金管理总部副总经理兼客户资金存管中心总经理等职务。2005年10月加入信达澳银基金管理有限公司,历任财务总监、总经理助理兼财务总监、副总经理。

王咏辉先生,总经理助理,英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士,20年证券、基金从业经验。曾任伦敦摩根大通(JPMorgan)投资基金管理公司分析员、高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(Barclays Capital)部门负责人,泰达宏利基金管理公司(Manulife Teda)国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理,鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司,任总经理助理兼投资总监。王咏辉先生具备基金从业资格,英国基金经理从业资格(IMC),英国IET颁发的特许工程师(CEng)认证资格。

2、基金经理

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹华龙	本基金的基金经理,安益债券基金、信用债债券基金的基金经理	2018-05-04	-	6年	中山大学经济学硕士。2012年7月至2015年7月任信达澳银基金管理有限公司债券研究员;2015年10月至2017年5月任华润元大基金管理有限公司高级研究员、基金经理;2017年5月加入信达澳银基金管理有限公司。信达澳银信用债债券基金基金经理(2018年5月4日起至今)、信达澳银鑫安债券基金(LOF)基金经理(2018年5月4日起至今)、信达澳银安益纯债债券基金基金经理(2018年5月4日起至今)。

3、公司投资审议委员会

公司公募基金投资审议委员会由6名成员组成,设主席1名,委员5名。名单如下:
主席:于建伟,总经理
委员:
王咏辉,投资总监、总经理助理
曾国富,公募投资总部副总监、基金经理
孔学峰,公募投资总部副总监、基金经理
邹运,投委会秘书、基金经理助理
刘涛,产品创新部总监
上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末,本集团资产总额216,920.67亿元,较上年末增加7,283.62亿元,增幅3.47%。上半年,本集团实现利润总额1,720.93亿元,较上年同期增长1.30%;净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元,盈利水平实现平稳增长。

2016年,本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》"2016中国最佳银行",《环球金融》"2016中国最佳消费者银行"、"2016亚太区最佳流动性管理银行",《机构投资者》"人民币国际化服务钻石奖",《亚洲银行家》"中国最佳大型零售银行奖"及中国银行业协会"年度最具社会责任金融机构奖"。本集团在英国《银行家》2016年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2.主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末,中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》"中国最佳托管银行"、"中国最佳次托管银行"、"最佳托管专家——QFII"等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"。

(二)基金托管人的内部控制制度

1.内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3.内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1.监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2.监督流程

(1)每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

(3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价,报送中国证监会。

(4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1、直销机构

名称:信达澳银基金管理有限公司
住所:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层
办公地址:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦T1栋8、9层
法定代表人:于建伟
电话:0755-82858168/0755-83077068
传真:0755-83077038
联系人:王丽燕
公司网址:www.fscinda.com
邮政编码:518054

2、代销机构

序号	名称	注册地址	法定代表人	办公地址	客服电话	联系人	网站
1	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区金融大街25号	王洪章	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	95533	邓艳明	www.ccb.com
2	招商银行股份有限公司	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦	李建红	同"注册地址"	95555	邓炯鹏	www.cmbchina.com
3	交通银行股份有限公司	上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路188号	彭 纯	同"注册地址"	95559	胡佳敏	www.bankcomm.com
4	中信银行股份有限公司	北京东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦中信银行总行12层	李庆萍	同"注册地址"	95558	王晓琳	www.citicbank.com
5	平安银行股份有限公司	深圳市罗湖区深南东路5047号	谢永林	同"注册地址"	95511-3	冯博	www.bank.pingan.com
6	杭州银行股份有限公司	杭州市下城区庆春路46号	陈震山	同"注册地址"	95398	金超龙	www.hccb.com.cn
7	南洋商业银行(中国)有限公司	上海市浦东新区世纪大道800号三层、六层至九层	陈孝周	上海市浦东新区世纪大道800号南洋商业银行大厦	4008302066	宋雯	www.ncbchina.cn/cn/index.html
8	恒丰银行股份有限公司	山东省烟台市芝罘区南大街248号	蔡国华	同"注册地址"	95395	李胜贤	www.hfbank.com.cn
9	信达证券股份有限公司	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	张志刚	同"注册地址"	95321	唐静	www.cindasc.com
10	中国银河证券股份有限公司	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层	陈共炎	同"注册地址"	95551/4008888888	邓颜	www.chinastock.com.cn
11	中信建投证券股份有限公司	北京市朝阳区安立路66号4号楼	王常青	北京市朝阳门内大街188号	95587/4008888108	许梦园	www.csc108.com
12	申万宏源证券有限公司	上海市徐汇区长乐路989号45层	李梅	上海市徐汇区长乐路989号45层	95523/4008895523	曹晔	www.swhysc.com
13	申万宏源西部证券有限公司	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	韩志谦	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	4008000562	唐岚	www.hysec.com
14	华龙证券股份有限公司	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼	李晓安	同"注册地址"	95368/4006898888	范坤、杨力	www.hlzqgs.com
15	中信证券股份有限公司	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	张佑君	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层	95558/4008895548	周雪晴	www.cs.ecitic.com
16	中信证券(山东)有限责任公司	青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层2001	姜晓林	同"注册地址"	95548	孙秋月	www.citicssd.com
17	国泰君安证券股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区商城路618号	杨德红	上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层	95521	芮敏祺、钟伟镇	www.gtja.com
18	光大证券股份有限公司	上海市静安区新闸路1508号	周健男	同"注册地址"	95525	刘晨	www.ebscn.com
19	兴业证券股份有限公司	福建省福州市湖东路268号	杨华辉	上海市浦东新区长柳路36号	95562	乔琳雪	www.xyzq.com.cn
20	海通证券股份有限公司	上海市黄浦区广东路689号	周杰	上海市广东路689号海通证券大厦	95553/4008888001	王立群	www.htsec.com
21	招商证券股份有限公司	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	霍达	同"注册地址"	95565	黄婵君	www.newone.com.cn
22	国信证券股份有限公司	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层	何如	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层	95536	容榕、李颖	www.guosen.com.cn
23	广发证券股份有限公司	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室	孙树明	广东省广州市天河区天河北路183号大都会广场5楼,7楼,8楼,17楼,18楼,19楼,38-44楼	95575	黄岚	www.gf.com.cn
24	安信证券股份有限公司	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层,28层A02单元	王连志	同"注册地址"	95517	郑向溢	www.essence.com.cn
25	平安证券股份有限公司	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层	刘世安	同"注册地址"	95511	石静武	stock.pingan.com
26	世纪证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层	姜昧军	同"注册地址"	4008323000	王雯、陈玮	www.csco.com.cn
27	华福证券有限责任公司	福州市鼓楼区温泉街道五四路157号新天地大厦7-9层	黄金琳	福州市五四路157号新天地大厦7至10层	95547	郭相兴	www.gfhfzq.com.cn
28	华泰证券股份有限公司	南京市江东中路228号	周易	南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场	95597	庞晓芸	www.htsc.com.cn
29	广州证券股份有限公司	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层,20层	邱三发	同"注册地址"	95396	梁微	www.gzs.com.cn
30	新时代证券股份有限公司	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501	叶顺德	同"注册地址"	95399	田芳芳	www.xsdzq.cn
31	长江证券股份有限公司	武汉市新华路特8号长江证券大厦	尤习贵	同"注册地址"	95579/4008888999	奚博宇	www.95579.com
32	浙商证券股份有限公司	浙江省杭州市江干区五星路201号	吴承根	同"注册地址"	95345	陈韵	www.stocke.com.cn
33	中泰证券股份有限公司	济南市市中区经七路86号	李玮	同"注册地址"	95538	秦雨晴、许曼华	www.zts.com.cn
34	联讯证券股份有限公司	惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层	徐刚	同"注册地址"	95564	彭莲	www.lxsec.com
35	长城证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层	丁益	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14层	4006666888	金夏、胡永君	www.cgws.com
36	恒泰证券股份有限公司	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼	庞介民	同"注册地址"	4001966188	熊丽	www.cnht.com.cn
37	太平洋证券股份有限公司	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼	李长伟	北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元	95397	王婧	www.tpyzq.com
38	国金证券股份有限公司	四川省成都市青羊区东城根上街95号	冉云	同"注册地址"	95310	刘婧漪	www.gjzq.com.cn
39	华金证券股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层	宋卫东	同"注册地址"	4008211357	黄昆龙	www.huajinsc.cn/
40	首创证券有限责任公司	北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座	吴涛	同"注册地址"	4006200620	刘宇	www.sczq.com.cn
41	华西证券股份有限公司	四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	杨炯洋	同"注册地址"	95584/4008888818	谢国梅	www.hx168.com.cn
42	山西证券股份有限公司	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	侯巍	同"注册地址"	95573/4006661618	郭熠	www.i618.com.cn
43	五矿证券有限公司	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元	赵立功	同"注册地址"	4001840028	濮耘瑶	www.wkzq.com.cn/
44	天相投资顾问有限公司	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	林义相	北京市西城区新街口外大街28号C座5层	66045555/66045678	尹伶	www.txsec.com/ www.jjm.com.cn
45	诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司	上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	汪静波	同"注册地址"	4008215399	余翼飞、邱佳捷	www.noah-fund.com
46	深圳众禄基金销售股份有限公司	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	薛峰	深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼	4006788887	童彩平	www.zlfund.cn www.jjmmw.com
47	上海天天基金销售有限公司	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	其实	上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼	95021/4001818188	王逐一	www.1234567.com.cn
48	上海好买基金销售有限公司	上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	杨文斌	同"注册地址"	4007009665	徐超逸	www.howbuy.com
49	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室	陈柏青	杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼	4000766123	徐丽玲、铄金、祝红艳	www.fund123.cn
50	和讯信息科技有限公司	北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室	王莉	同"注册地址"	4009200022	刘洋	licaike.hexun.com
51	浙江同花顺基金销售有限公司	杭州市文二西路一号903室	凌顺平	同"注册地址"	4008773772	朱琼	www.5ifund.com
52	上海联泰资产管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室	燕斌	上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼	4001181188	陈东	www.66zichan.com
53	北京展恒基金销售股份有限公司	北京市顺义区后沙峪镇安富街6号	闫振杰	北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层	4008188000	乌兰其其格、李露平	www.myfund.com
54	众升财富(北京)基金销售有限公司	北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	李招弟	北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	4008769988	李艳	www.wy-fund.com
55	上海长量基金销售投资顾问有限公司	上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	张跃伟	上海市浦东新区东方路1267号11层	4008202899	詹慧萌	www.erichfund.com
56	嘉实财富管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元	赵学军	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层	4000218850	余永键	www.harvestwm.cn
57	北京虹点基金销售有限公司	北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元	胡伟	北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层	4006180707	葛亮	www.hongdianfund.com
58	上海陆金所基金销售有限公司	上海市自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元	王之光	同"注册地址"	4008219031	程晨	www.lufunds.com
59	上海利得基金销售有限公司	上海市宝山区蕴川路5475号1033室	李兴春	上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼	4000676266	曹怡晨	a.leadfund.com.cn
60	珠海盈米财富管理有限公司	珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491	肖雯	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203	89629066	邱湘湘、曾健灿	www.yingmi.cn
61	北京创金启富投资管理有限公司	北京市西城区西单民丰胡同31号中水大厦215A室	梁蓉	北京西城区白纸坊东街2号经济日报社A综合楼712室	4006262818	郭爱丽	www.5irich.com
62	北京钱景基金销售有限公司	北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012	赵荣春	同"注册地址"	4008936885	陈剑炜	www.qianjing.com
63	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室	钱昊旻	北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层	4008909998	孙雯	www.jnlc.com
64	北京广源达信基金销售有限公司	北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室	齐剑辉	北京市朝阳区望京宏泰东街 浦项中心B座19层	4006236060	王英俊	www.niuniufund.com
65	北京晟视天下投资管理有限公司	北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室	蒋煜	北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层	4008188866/010-58170761	殷雯	www.shengshiview.com
66	上海万得基金销售有限公司	中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座	王廷富	上海市浦东新区福山路33号8楼	4008210203	徐亚丹	www.520fund.com.cn
67	北京富国大通资产管理有限公司	北京市东城区北三环东路36号1号楼A2501室	宋宝峰	同"注册地址"	4000880088	张玥	www.fuguowealth.com
68	上海基煜基金销售有限公司	上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)	王翔	上海市杨浦区昆明路518号A1002室	4008205369	吴鸿飞	www.jiyufund.com.cn
69	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室	张冠宇	北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层	4008199868	刘美薇	www.tdyhfund.com
70	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704	马勇	北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层	4001661188	文雯	8.jrj.com.cn/
71	北京汇成基金销售有限公司	北京市海淀区中关村大街11号11层1108	王伟刚	同"注册地址"	4006199059	熊小满、李瑞真	www.hcjijin.com
72	大泰金石基金销售有限公司	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	袁顾明	同"注册地址"	4009282266	何庭宇	www.dtfunds.com
73	中民财富基金销售(上海)有限公司	上海市黄浦区中山南路100号7层05单元	弭洪军	上海市黄浦区中山南路100号17层	4008765716	茅旦青	www.cmiwm.com
74	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06	江卉	北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部	95118/4000988511	万容	kenterui.jd.com/ fund.jd.com/
75	喜鹊财富基金销售有限公司	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室	陈皓	同"注册地址"	4006997719	曹砚财	www.xiquefund.com
76	一路财富(北京)信息科技股份有限公司	北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	吴雪秀	同"注册地址"	4000011566	徐越	www.yilucaifu.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

(2)场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,具体销售机构见深圳证券交易所网站(www.szse.com)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-59378839
传真:010-59378907
联系人:朱立元

(三)律师事务所和经办律师

名称:上海源泰律师事务所
办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
电话:021-51150298
传真:021-51150398
联系人:刘佳
经办律师:刘佳、徐莘

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法定代表人(执行事务合伙人):毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:昌华
经办注册会计师:昌华、高鹤

四、基金的名称

信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)

五、基金的运作方式和类型

运作方式:上市契约型开放式(LOF)
类型:债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

通过积极主动的投资及严格的风险控制,追求长期稳定的回报,力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资范围

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股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、权证以及法律法规或中、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的相关规定)。

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

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%;基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素综合分析,评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。

2、债券投资策略

(1)类属资产配置

本基金将市场细分为不同类属,定期跟踪分析不同类属的风险收益特征,并结合该类属的市场容量、流动性确定其投资比例范围,把上述数据和目标久期等输入债券类属配置模型得到债券组合中不同类属配置比例。

本基金还将根据市场实际利率与公允值的差异、市场风险水平对最优配置比例进行调整。当市场实际利率高于公允值时,本基金将逐步增加这类资产的头寸,目的是获得有吸引力的收入流,反之亦然。

(2)收益率曲线配置策略

本基金将分析收益率曲线形态的变化,通过预测收益率曲线形态的变化,决定采用骑乘、子弹、杠铃或者梯形等策略。当预测收益率曲线为陡峭正向且较为稳定不发生形变时,采用骑乘策略及兼用杠杆放大策略;当预测收益率曲线平移或平坦化时,采取哑铃或梯形策略构建高凸性组合;当预测收益率陡峭化时,采用子弹形策略。

(3)信用债投资策略

本基金信用债投资策略的核心是分散化及风险收益率的优化。

本基金将保持组合内各券种的分散化及券种之间的低相关性以获得正超额收益。

本基金在个券选择方面采用风险收益率优化策略。本基金首先采取与股票投资相似的公司分析方式,对信用债发行人的公司治理、发展前景、经营管理、财务状况及偿债能力作出综合评价,从而判断企业债的信用风险和估值水平。本基金同时对信用债市场进行跟踪分析,关注宏观经济、政策环境、信用环境等对市场利差水平的影响。本基金将根据个券的估值及在市场中的水平动态调整组合,买入低估和风险收益相对高的个券,卖出高估和风险收益相对低的个券。

(4)可转债投资策略

本基金对可转债的投资将主要采用公司分析方式,依据QGV、ITC、MDE体系全面评价正股的投资价值和债券的信用风险,并分别对期权部分和债券部分进行估值,从而客观评判可转债的投资价值。同时,本基金将全面分析可转债市场各券种的股债性、流动性、收益率、信用水平等特征,根据本基金的类属配置策略、流动性管理要求和前述个券投资价值,精选个券投资。

(5)国债及中央银行票据投资策略

本基金对该类品种的投资主要专注于对影响利率水平及其预期、通胀水平及其预期的各种参数的分析和判断,如国际国内经济周期、GDP增长率及其变化趋势、通货膨胀率及其预期、财政货币政策等,以期预测未来的利率期限结构,并基于该期限结构进行估值,以期对个券的利率风险和投资价值作出较准确的判断,策略性地决定债券投资的久期、期限结构,从而管理债券投资风险和收益。在平稳的市场利率环境下,通过回购套利投资国债及中央银行票据可以获得具备较好流动性的利差收益。对于跨市场发行的国债,由于银行间和交易所市场构成差异,还可获得跨市场交易的套利收益。国债及中央银行票据具备良好的抵押回购融资功能,对放大基金资产投资,应急大额基金赎回起到流动性支持作用。

(6)资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略投资于资产支持证券。

(7)中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债券具有流动性较差、信息披露不公开、风险收益水平较高等特点,因此对该类信用产品的投资主要遵循精选个券、总量控制、分散投资、长期持有的原则。对个券投资前主要采取与股票投资相似的公司分析方式,对中小企业私募债券发行人的公司治理、发展前景、经营管理、财务状况及偿债能力作出综合评价,从而选择收益率水平与信用风险匹配,利差对违约风险和流动性风险构成合理补偿的个券进行投资。投资以后以高于普通信用债的频度对发行人的情况进行密切跟踪,包括且不限于对发行人进行电话和实地调研,与受托人、投行、评级机构等中介机构进行信息沟通等等,以保持对发行人经营状况和偿债能力变化情况的了解。对于组合里的中小企业私募债券暴露,根据本基金的类属配置策略、个券的投资价值和流动性管理要求,进行总量控制、分散投资,降低流动性和信用风险。

3、股票投资策略

对二级市场股票投资,本基金将在资产配置总体策略下,运用"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金的权益资产组合。一方面,本基金通过"自上而下"的深入分析,在结合国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策的基础上,优化配置、甄选受益行业;另一方面,通过"自下而上"的深入分析精选公司素质高、核心竞争力突出、估值合理的公司,依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力,力争获得良好回报。

4、权证投资策略

本基金将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征以选择权证的卖出时机,追求较为稳健的当期收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深300指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%

本基金是债券型基金,投资于债券资产不低于基金资产的80%,投资于股票等权益类资产不高于基金资产的20%,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金采用"中债总财富(总值)指数收益率"、"沪深300 指数收益率"和"金融机构人民币活期存款基准利率(税后)"分别作为股票、债券和现金类资产投资的比较基准,并将业绩比较基准中债券指数、股票指数与现金类资产的权重确定为80%、15%和5%,基于指数的权威性和代表性以及本基金的投资范围和投资理念,选用该业绩比较基准能够真实、客观的反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,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的业绩基准的指数时,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人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、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金

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复核了本次更新招募说明书中的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。

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。

本投资组合报告期截止至2018年3月31日。本报告中财务资料未经审计。

一)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	1,384,694.55	11.33
	其中:股票	1,384,694.55	11.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,687,500.80	79.28
	其中:债券	9,687,500.80	79.28
	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	500,000.00	4.09
	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	225,971.15	1.85
8	其他资产	421,281.11	3.45
9	合计	12,219,447.61	100.00

二)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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	873,929.55	7.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	78,600.00	0.70
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	261,500.00	2.33
J	金融业	43,635.00	0.39
K	房地产业	75,590.00	0.67
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	-	-
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	51,440.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	1,384,694.55	12.36

2. 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

三)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	000063	中兴通讯	6,597	198,899.55	1.77
2	300623	捷捷微电	2,000	138,000.00	1.23
3	600584	长电科技	5,000	108,700.00	0.97
4	600436	片仔癀	1,000	82,980.00	0.74
5	000963	华东医药	1,200	78,600.00	0.70
6	600372	中航电子	4,000	62,400.00	0.56
7	300036	超图软件	3,000	62,310.00	0.56
8	300188	美亚柏科	2,000	62,000.00	0.55
9	300308	中际旭创	800	61,080.00	0.55
10	603019	中科曙光	1,000	54,710.00	0.49

四)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	7,123,142.80	63.56
	其中:政策性金融债	7,123,142.80	63.56
4	企业债券	1,402,660.00	12.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,161,698.00	10.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,687,500.80	86.44

五)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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108601	国开1703	46,500	4,648,605.00	41.48
2	018005	国开1701	24,790	2,474,537.80	22.08
3	122392	15恒大02	9,000	903,510.00	8.06
4	112281	15中洲债	5,000	499,150.00	4.45
5	123005	万信转债	2,000	262,520.00	2.34

六)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。

七)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。

八)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。

九)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

注:本基金未参与投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

十)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报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,716.83
2	应收证券清算款	111,782.83
3	应收股利	-
4	应收利息	293,681.53
5	应收申购款	99.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	421,281.11

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	221,145.60	1.97

注:本基金本报告期末仅持有上述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

注: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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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财产,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预示其未来表现。投资有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

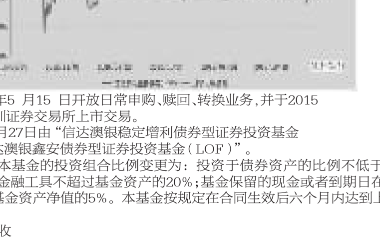
(一)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截至2018年3月31日):

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
2012年(2012年5月7日至2012年12月31日)	2.01%	0.13%	2.00%	0.08%	0.01%	0.05%
2013年(2013年1月1日至2013年12月31日)	-6.43%	0.39%	-2.10%	0.11%	-4.33%	0.28%
2014年(2014年1月1日至2014年12月31日)	21.15%	0.49%	11.23%	0.15%	9.92%	0.34%
2015年至转型前一日(2015年1月1日至2015年5月6日)	-0.88%	0.71%	1.79%	0.14%	-2.67%	0.57%
自基金合同生效起至转型前一日(2012年5月7日至2015年5月6日)	14.62%	0.44%	13.06%	0.12%	1.56%	0.32%

自基金转型为信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)期间,业绩如下:

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
自基金转型日起至2015年底(2015年5月7日至2015年12月31日)	-1.00%	0.94%	6.13%	0.10%	-7.13%	0.84%
2016年(2016年1月1日至2016年12月31日)	-3.64%	0.21%	1.13%	0.12%	-4.77%	0.09%
2017年(2017年1月1日至2017年12月31日)	1.15%	0.15%	2.10%	0.12%	-0.95%	0.03%
2018年(2018年1月1日至2018年3月31日)	-0.41%	0.36%	1.28%	0.17%	-1.69%	0.19%
自基金转型日起至今(2015年5月7日至2018年3月31日)	-3.90%	0.49%	10.98%	0.12%	-14.88%	0.37%

(二)自基金转型为信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较:



注:1、本基金于2015 年5 月15 日开放日常申购、赎回、转换业务,并于2015年6 月4 日开始在深圳证券交易所上市交易。

2、本基金于2016年12月27日由"信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)"变更为"信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)"。

3、2016年12月27日起本基金的投资组合比例变更为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%;基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金财产拨划支付的银行费用;
4.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5.基金份额持有人大会费用;
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
7.基金的证券交易费用;
8.基金上市初费和上市月费;
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况在履行适当的程序后调整基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人对2018年2月6日生效的本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

(一)在"重要提示"部分,修改了本基金更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期;

(二)在"三、基金管理人"部分,更新了管理人的相关信息:

1、更新了基金管理人证券投资基金管理情况
2、更新了基金管理人董事、监事、高级管理人员的相关信息;
3、更新了基金经理的相关信息;
4、更新了公司投资审议委员会的相关信息;

(三)在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关信息;

(四)在"五、相关服务机构"部分,更新了代销机构、律师事务所和经办律师的相关信息;

(五)在"九、基金的投资"部分,更新了本基金最近一期投资组合报告内容,数据截至2018年3月31日;

(六)在"十、基金的业绩"部分,更新了基金业绩相关数据,数据截至2018年3月31日;

(七)在"二十一、其他应披露事项"部分,更新了本基金的其他应披露事项列表;

(八)根据中国证监会2017年8月31日颁布、2017年10月1日起正式实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》要求,对本基金招募说明书中的相关内容进行了相应修改。

信达澳银基金管理有限公司
二〇一八年八月八日