易方达裕祥回报债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
二〇一八年九月

重要提示

本基金根据2016年1月5日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达裕祥回报债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]13号）进行募集。本基金基金合同于2016年1月22日正式生效。

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。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。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，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。

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。投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读本基金的招募说明书和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和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，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，承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作风险；因交收违约和投资债券引发的信用风险；本基金投资范围包括中小企业私募债、证券公司短期公司债券等品种，可能给本基金带来额外风险；债券市场系统性风险；股票市场风险等。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的"风险揭示"部分。

本基金为债券型基金，理论上其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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引致的投资风险，由投资者自行负责。此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破1元初始面值的风险。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，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》。

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并不构成对本基金表现的保证。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2018年7月22日，有关财务数据截止日为2018年6月30日，净值表现截止日为2018年6月30日。（本报告中财务数据未经审计）

一、基金管理人
（一）基金管理人基本情况
1.基金管理人：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室－42891（集中办公区）
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
设立日期：2001年4月17日
法定代表人：刘晓艳
联系电话：400 881 8088
联系人：李红枫
注册资本：12,000万元人民币
批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号
经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理
2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总　计	100%

（二）主要人员情况
1.董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，工商管理博士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理、广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。现任广发证券股份有限公司执行董事、常务副总经理；广发控股（香港）有限公司董事、广发证券资产管理（广东）有限公司董事长。

陈志辉先生，管理学硕士，董事。曾任美的集团税务总监、安永会计师事务所广州分所高级审计员。现任盈峰投资控股集团有限公司资财中心总经理。

王海先生，经济学、工商管理（国际）硕士，董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问室科员；工商银行珠海分行法律顾问室办事员、营业部计划信贷部信贷员、办公室行长室秘书、信贷管理部业务主办、资产风险管理部经理助理兼法律室副主任、资产风险管理部副总经理兼法律室主任、资产风险管理部总经理；招商银行总行法律事务部行员；工商银行珠海分行资产风险部总经理兼特殊资产管理部负责人、公司业务部总经理、副行长；工商银行广东省分行公司业务部副总经理（主持工作）、总经理；工商银行韶关分行行长、党委书记。现任广东粤财信托有限公司总经理。

戚思胤先生，经济学硕士，董事。曾任广东省高速公路发展股份有限公司证券部投资者关系管理业务员、投资者关系管理主管、信息披露主管、证券事务代表；广东省广晟资产经营有限公司资本运营部高级主管、团委副书记、副部长；（香港）广晟投资发展有限公司董事、常务副总经理等职务。现任广东省广晟资产经营有限公司资本运营部部长、佛山电器照明股份有限公司董事、深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事、佛山市国星光电股份有限公司董事、广东南粤银行股份有限公司董事。

朱征夫先生，法学博士，独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融房地产部主任；广东大陆律师事务所合伙人；广东省国土厅广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

忻榕女士，工商行政管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州高温橡胶公司市场部经理；美国加州大学讲师；美国南加州大学助理教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理；广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

赵必伟先生，经济学专业研究生，监事。曾任广州市财政局第四分局工作专管员，广州市税务局对外分局工作科长、副局长，广州市广永国有资产经营有限公司董事副总裁、总裁；曾兼任香港广永财务有限公司副总经理、总经理，广州市广永经贸公司总经理，广州银行股份有限公司副董事长，广州广永丽都酒店有限公司董事。现任广州市广永国有资产经营有限公司董事长、党总支书记，兼任广州赛马娱乐总公司董事，广州银行股份有限公司董事。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管；易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张优造先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理；广东证券公司发行上市部经理；深圳证券业务部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理，研发部经理，证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达国际控股有限公司董事。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳众大投资有限公司投资部副经理；广发证券有限责任公司投资部副总经理；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科汇基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、固定收益投资决策委员会委员。

吴欣荣先生，工学硕士，副总裁。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、权益投资总部总经理、总裁助理、权益投资总监、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁、易方达国际控股有限公司董事。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、债券基金部副总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官；易方达资产管理（香港）有限公司董事、投资决策委员会委员。

关秀霞女士，财务硕士、工商管理硕士，首席国际业务官。曾任中国银行（香港）分析员；Daniel Dennis高级审计师；美国道富银行波士顿和亚洲总部大中华地区高级副总裁、董事总经理、中国区行长、亚洲区（除日本外）副总裁、机构服务主管、美国共同基金业务风险经理、公司内部审计高级审计师。现任易方达基金管理有限公司首席国际业务官。

高松凡先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），首席养老金业务官。曾任招商银行总行人事部高级经理、企业年金中心副主任，浦东发展银行总行企业年金部总经理，长江养老保险公司首席市场总监，易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司首席养老金业务官。

陈荣女士，经济学博士。曾任中国人民银行广州分行统计研究处科员，易方达基金管理有限公司运作支持部经理、核算部总经理助理、核算部副总经理、投资风险管理部副总经理、公司总裁助理。现任易方达基金管理有限公司首席运营官，兼任公司财务中心主任；易方达资产管理（香港）有限公司董事；易方达资产管理有限公司监事；易方达海外投资（深圳）有限公司监事。

汪兰英女士，工学学士、法学学士。曾任中信证券股份有限公司风险投资部投资经理助理，中国证监会基金监管部副主任科员、主任科员、副处长、处长，中国人寿资产管理有限公司风险管理部副总经理（主持工作）、项目评审部副总经理（主持工作）、基金投资部副总经理（主持工作）。现任易方达基金管理有限公司首席大类资产配置官；易方达资产管理有限公司董事。

2.基金经理

张清华先生，物理学硕士。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年4月2日至2018年2月1日）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年4月17日至2018年2月1日）、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年12月9日至2018年2月1日）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年3月15日至2018年2月1日）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年3月15日至2018年2月1日）、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年3月29日至2018年2月1日）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年8月6日至2018年2月1日）、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月7日至2018年2月1日）、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月15日至2018年2月1日）、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年1月11日至2018年2月1日）。现任易方达基金管理有限公司固定收益基金投资部总经理、易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理（自2013年12月23日起任职）、易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理（自2014年1月9日起任职）、易方达安心回馈混合型证券投资基金基金经理（自2015年5月29日起任职）、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理（自2016年1月22日起任职）、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理（自2016年9月5日起任职）、易方达丰和债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月23日起任职）、易方达安盈回报混合型证券投资基金基金经理（自2017年2月16日起任职）、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年1月30日起任职）、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年2月7日起任职）、易方达鑫转添利混合型证券投资基金基金经理（自2018年8月9日起任职）。

林森先生，经济学硕士，工商管理硕士。曾任道富银行风险管理部风险管理经理、外汇利率交易部利率交易员，太平洋资产管理公司基金管理部基金经理，易方达基金管理有限公司投资经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理助理。现任易方达基金管理有限公司易方达安心回馈混合型证券投资基金基金经理（自2015年11月28日起任职）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年3月15日起任职）、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年1月26日起任职）、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年3月7日起任职）、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年3月7日起任职）、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理（自2017年7月28日起任职）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年12月30日起任职）、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年12月30日起任职）、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2018年2月10日起任职）、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理（自2018年3月24日起任职）。

林虎先生，经济学博士。曾任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师。现任易方达基金管理有限公司易方达保本一号混合型证券投资基金基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理助理。

本基金历任基金经理情况：张雅君女士，管理时间为2016年6月2日至2017年7月27日。

3.固定收益投资决策委员会成员
本公司固定收益投资决策委员会成员包括：马骏先生、王晓晨女士、张清华先生、袁方女士、胡剑先生
马骏先生，同上。

王晓晨女士，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益基金投资部副总经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达保本一号混合型证券投资基金基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金基金经理、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、易方达资产管理（香港）有限公司固定收益投资决策委员会委员。

张清华先生，同上。

袁方女士，工学硕士。曾任中慧会计师事务所审计师、资产评估师，湘财证券有限责任公司投资经理，泰康人寿保险公司投资经理，天弘基金管理有限公司基金经理、固定收益总监，泰康资产管理有限责任公司年金投资部高级投资经理、执行总监，易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理助理、固定收益总部总经理助理、固定收益机构投资部总经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益专户投资部总经理、投资经理。

胡剑先生，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益研究部总经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人
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：高国富
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；提供保管箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；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；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；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：293.52亿元人民币
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：胡波
联系电话：（021）61618888

三、相关服务机构
（一）基金份额销售机构
1.直销机构：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室－42891（集中办公区）
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：刘晓艳
电话：020-85102506
传真：4008818099
联系人：李红枫
网址：www.efunds.com.cn
直销机构网点信息：
（1）易方达基金管理有限公司广州直销中心
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼
电话：020-85102506
传真：400 881 8099
联系人：李红枫
（2）易方达基金管理有限公司北京直销中心
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座1703室
电话：010-63213377
传真：400 881 8099
联系人：刘蕾
（3）易方达基金管理有限公司上海直销中心
办公地址：上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦46楼
电话：021-50476668
传真：400 881 8099
联系人：于楠
（4）易方达基金管理有限公司网上交易系统
网址：www.efunds.com.cn
2.非直销销售机构
（1）广发证券
注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场5、7、8、17-19、38-44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn
（二）基金登记机构
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室－42891（集中办公区）
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：刘晓艳
电话：4008818088
传真：020-38799249
联系人：余贤高
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所：国浩律师(广州)事务所
地址：广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层
负责人：程秉
电话：020-38799345
传真：020-38799345-200
经办律师：黄贞、陈桂华
联系人：黄贞
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
主要经营场所：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
执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁
电话：010-58153000
传真：010-85188298
经办注册会计师：赵雅、李明明
联系人：赵雅

四、基金的名称
易方达裕祥回报债券型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式债券型证券投资基金
六、基金的投资目标
本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等债券资产，股票（含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、权证等权益类品种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。
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。
本基金各类资产的投资比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票资产不高于基金资产的20%；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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
八、基金的投资策略
1.资产配置策略
本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票、债券和银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。
2.债券资产投资策略
（1）债券投资策略
本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。
①在久期配置方面，本基金将对宏观经济走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策动向等进行研究，预测未来收益率曲线变动趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。
②在类属配置方面，本基金将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化，以及信用债券的信用风险等因素进行分析，根据各债券类属的风险收益特征，定期对债券类属资产进行优化配置和调整，确定债券类属资产的最优权重。
③在期限结构配置方面，本基金将对市场收益率曲线变动情况进行研判，在长期、中期和短期债券之间进行配置，适时采用子弹型、哑铃型或梯型策略构建投资组合，以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。
④在个券选择方面，对于国债、央行票据等非信用类债券，本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种；对于信用类债券，本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。
⑤证券公司短期公司债券投资策略
本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。
⑥中小企业私募债投资策略
本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债进行投资，主要采取分散化投资策略，控制个债持有比例。同时，紧密跟踪研究发债企业的基本面情况变化，并据此调整投资组合，控制投资风险。
（2）可转换债券及可交换债券投资策略
可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债和可交换债券新券的申购。
（3）杠杆投资策略
本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作放大组合收益。
（4）银行存款投资策略
本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款投资具有较高投资价值时，本基金将提高银行存款投资比例。
3.股票投资策略
本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取"自下而上"的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。
4.权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。
5.未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。
十、基金的风险收益特征
本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告（未经审计）
本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。
本基金的托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告有关数据的期间为2018年4月1日至2018年6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	152,747,708.73	16.03
	其中：股票	152,747,708.73	16.03
2	固定收益投资	759,339,278.97	79.68
	其中：债券	759,339,278.97	79.68
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	8,000,000.00	0.84
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	8,474,136.12	0.89
7	其他资产	24,446,859.26	2.57
8	合计	953,007,983.08	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	–	–
C	制造业	127,072,495.96	16.57
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	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	5,160,638.64	0.67
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,836,663.13	1.93
J	金融业	4,346,636.00	0.57
K	房地产业	1,331,275.00	0.17
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	152,747,708.73	19.92

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	000651	格力电器	356,254	16,797,376.10	2.19
2	002376	新北洋	831,200	13,748,048.00	1.79
3	002236	大华股份	589,600	13,295,480.00	1.73
4	601012	隆基股份	717,430	11,973,906.70	1.56
5	002008	大族激光	195,026	10,373,432.94	1.35
6	600585	海螺水泥	272,600	9,126,648.00	1.19
7	600845	宝信软件	336,411	8,864,429.85	1.16
8	300136	信维通信	231,814	7,123,644.22	0.93
9	601799	星宇股份	102,525	6,140,222.25	0.80
10	300271	华宇软件	337,796	5,972,233.28	0.78

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	44,758,500.00	5.84
	其中：政策性金融债	44,758,500.00	5.84
4	企业债券	369,569,212.90	48.20
5	企业短期融资券	60,014,000.00	7.83
6	中期票据	197,241,000.00	25.72
7	可转债（可交换债）	87,756,566.07	11.44
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	759,339,278.97	99.02

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

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	0980103	09开滦债	500,000	49,820,000.00	6.50
2	011800340	18南山集SCP003	400,000	40,056,000.00	5.22
3	101764017	17六合国资MTN001	400,000	39,696,000.00	5.18
4	160208	16国开08	350,000	34,765,500.00	4.53
5	101361013	13渝能源MTN001	300,000	30,276,000.00	3.95

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股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。
10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。
11.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出现被监管部门立案调查，或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没有超出基金合同规定的备选股票库。
（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	95,405.04
2	应收证券清算款	9,940,785.71
3	应收股利	–
4	应收利息	14,408,668.51
5	应收申购款	2,000.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	24,446,859.26

（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	123003	蓝思转债	19,046,508.25	2.48
2	113014	林洋转债	15,706,272.00	2.05
3	113015	隆基转债	11,325,224.00	1.48
4	128015	久其转债	8,432,330.40	1.10
5	128028	赣锋转债	3,900,746.46	0.51
6	110039	宝信转债	3,387,585.60	0.44
7	110032	三一转债	1,261,767.20	0.16

（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、基金的业绩
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。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。
本基金合同生效日为2016年1月22日，基金合同生效以来（截至2018年6月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率（1）	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）
自基金合同生效日至2016年12月31日	2.00%	0.16%	2.50%	0.20%	-0.50%	-0.04%
2017年1月1日至2017年12月31日	8.43%	0.25%	3.30%	0.11%	5.13%	0.14%
2018年1月1日至2018年6月30日	0.45%	0.46%	1.09%	0.18%	-0.64%	0.28%
自基金合同生效日至2018年6月30日	11.10%	0.28%	7.03%	0.16%	4.07%	0.12%

十三、费用概览
（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.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
5.基金份额持有人大会费用；
6.基金的证券交易费用；
7.基金的银行汇划费用；
8.证券账户开户费用、银行账户维护费用；
9.按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
（二）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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.40%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
2.基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.1%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
上述"（一）基金费用的种类中第3－9项费用"，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（三）不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1.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；
2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3.《基金合同》生效前的相关费用；
4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（四）与基金销售有关的费用
1.申购费
（1）申购费率
本基金对通过直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。
特定投资群体可通过本公司直销中心申购本基金。基金管理人可根据情况变更或增减特定投资群体申购本基金的销售机构，并按规定予以公告。
通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资群体申购费率见下表：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M＜100万	0.10%
100万≤M＜200万	0.08%
200万≤M＜500万	0.04%
M≥500万	1,000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率见下表：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M＜100万	1.0%
100万≤M＜200万	0.8%
200万≤M＜500万	0.4%
M≥500万	1,000元/笔

（2）申购费的收取方式和用途
在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。
本基金的申购费用由申购基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。
（3）申购份额的计算
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）
（注：对于500万（含）以上适用固定金额申购费的申购，净申购金额＝申购金额－固定申购费金额）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/ T日基金份额净值
申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
2.赎回费
（1）赎回费率
本基金赎回费率见下表：

持有时间（天）	赎回费率
0-6	1.50%
7-29	0.75%
30-364	0.10%
365-729	0.08%
730-1094	0.06%
1095及以上	0%

（2）赎回费的收取和用途
赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。所收取的赎回费全额计入基金财产。
（3）赎回金额的计算
赎回金额的计算方法如下：
赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回费用
赎回费用、赎回金额的单位为人民币元，计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
3.基金转换费由基金份额持有人承担，由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用按照各基金的基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。
4.投资者通过本公司网上交易系统（www.efunds.com.cn）进行申购、赎回和转换的交易费率，请具体参照我公司网站上的相关说明。
5.基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。
6.基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。
十四、对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2018年3月8日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：
1. 在"一、绪言"部分，更新了部分内容。
2. 在"二、释义"部分，更新了部分内容。
3. 在"三、基金管理人"部分，更新了部分内容。
4. 在"四、基金托管人"部分，更新了部分内容。
5. 在"五、相关服务机构"部分，更新了基金份额销售机构信息和基金登记机构信息。
6. 在"八、基金份额的申购、赎回"部分，更新了部分内容。
7. 在"九、基金转换和定期定额投资计划"部分，更新了部分内容。
8. 在"十一、基金的投资"部分，更新了部分内容，并更新了本基金2018年第2季度投资组合报告的内容。
9. 在"十二、基金的业绩"部分，更新了基金的投资业绩数据。
10. 在"十四、基金资产的估值"部分，更新了部分内容。
11. 在"十八、基金的信息披露"部分，更新了部分内容。
12. 在"十九、风险揭示"部分，更新了部分内容。
13. 在"二十二、基金托管协议的内容摘要"部分，更新了部分内容。
14. 在"二十四、其他应披露事项"部分，根据相关公告的内容进行了补充。

易方达基金管理有限公司
2018年9月5日

易方达基金管理有限公司关于增加浦发银行为易方达科顺定期开放灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告

根据易方达基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称"浦发银行"）签署的基金销售服务协议，本公司自2018年9月7日起增加浦发银行为易方达科顺定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"，基金代码：161132）的销售机构。
重要提示：2018年9月7日至2018年10月19日为本基金的认购期。
投资者可通过以下途径咨询有关详情：
1.浦发银行
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：高国富
联系人：高天、肖武侠
联系电话：021-61618888
客户服务电话：95528
传真：021-63604196
网址：www.spdb.com.cn
2.易方达基金管理有限公司
客户服务电话：400-881-8088
网址：www.efunds.com.cn
风险提示：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，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。
特此公告。

易方达基金管理有限公司
2018年9月5日

易方达生物科技指数分级证券投资基金B类份额交易价格波动提示公告

近期，易方达基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）旗下易方达生物科技指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称：生物B，场内代码：150258）二级市场交易价格波动较大。2018年9月3日，易方达生物科技分级B类份额在二级市场的收盘价为1.126元，相对于当日0.8840元的基金份额参考净值，溢价幅度达到27.38%。截止2018年9月4日，易方达生物科技分级B类份额二级市场的收盘价为1.186元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资于高溢价率的分级基金，可能遭受重大损失。
为此，本基金管理人提示如下：
1、根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《资管新规》）要求，公募产品不得进行份额分级，存量分级基金须在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范，请投资者关注相关风险，如溢价买入可能造成较大损失。
2、易方达生物科技分级B类份额表现为高风险、高收益的特征。由于易方达生物科技分级B类份额内含杠杆机制的设计，易方达生物科技分级B类份额参考净值的变动幅度将大于易方达生物科技分级份额（场内简称：生物分级，场内代码：161122）净值和易方达生物科技分级A类份额（场内简称：生物A，场内代码：150257）参考净值的变动幅度，即易方达生物科技分级B类份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。易方达生物科技分级B类份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。
3、易方达生物科技分级B类份额的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。
4、截至本公告披露日，易方达生物科技指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。
5、截至本公告披露日，易方达生物科技指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。
6、风险提示：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，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。
敬请投资者注意投资风险。
特此公告。

易方达基金管理有限公司
2018年9月5日

易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告

近期，易方达基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）旗下易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：ZZ500ETF；交易代码：510580，以下简称"本基金"）二级市场交易价格连续波动，2018年9月3日，本基金二级市场收盘价为5.163元，相对于当日4.8001元的基金份额参考净值，溢价幅度达到7.56%。截止2018年9月4日，本基金二级市场收盘价为5.290元，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目投资于高溢价率的基金，可能遭受重大损失。
为此，本基金管理人提示如下：
1.本基金基金合同生效日为 2015年8月27日，并于2015年9月14日开始在上海证券交易所上市交易，投资者可通过上海证券交易所买卖基金份额。
2.本基金二级市场的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资者面临损失。
3.截至本公告披露日，本基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。
4.截至本公告披露日，本基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。
5.风险提示：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，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。
敬请投资者注意投资风险。
特此公告。

易方达基金管理有限公司
2018年9月5日

上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第1号）

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
重要提示
本基金于2016年10月8日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】2317号文准予注册。本基金的基金合同于2017年1月23日正式生效。本基金类型为交易型开放式。
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。
投资有风险，投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，自主、谨慎做出投资决策。
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并不构成新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。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。
本招募说明书所载内容截止日为2018年7月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分　基金管理人

一、基金管理人概况
名称：海富通基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
法定代表人：张文伟
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38650999
联系人：吴晨莺
注册资本：1.5亿元人民币
股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BE控股公司49%。
二、主要人员情况
张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理，海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。
任志强先生，董事，总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书，华宝信托投资有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。
杨明先生，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银行新余支行办公室科员，证券业务部负责人，海通证券业务部副主任、营业部总经理、海通证券有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、副总经理，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。
吴淑琨先生，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理，机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。
Ligia Torres（陶乐斯）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，历任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎投资管理亚洲区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司首席执行官。
Alexandre Werno(韦历山)先生，董事，法国籍，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事，中国业务开发负责人职务；2013年5月至2017年11月先后任法国巴黎资产管理有限公司总经理高级顾问、亚洲区首席业务运营官职务；2017年11月至今担任法国巴黎资产管理亚太区战略合作总监。
郑国汉先生，独立董事，美国籍，经济学硕士及博士学位。历任美国俄亥俄州达顿大学助理教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。
Marc Bayot（巴约特）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学金融学荣誉教授，EFAMA（欧洲基金和资产管理协会）和比利时基金协会（BEAMA）INVESTPROTECT公司（布鲁塞尔）董事会总经理、Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事，现任 Pioneer投资公司（米兰、都柏林、卢森堡）独立董事、Fundconnect独立董事和法国巴黎银行B Flexible SICAV 独立董事。
杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理，上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。
张馨先生，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财政金融系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。
杨仓兵先生，监事长，管理学学士。历任安徽省农业科学院计财科副科长，安徽实业有限公司财务部干部、经理，海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理，计划资金部副总经理、海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资金管理总部总经理。
Bruno Weil（魏海诺）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚业务负责人、亚洲融资项目副总经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。
俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司，历任产品与创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司监事。
奚万荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。
章明女士，副总经理，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理，加拿大Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长，2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。2016年12月至2018年3月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。
陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长，上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。
何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政局会科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、富国基金管理公司投资经理、研究总监等职务。2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任海富通基金管理有限公司副总经理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。
陈轶平先生，博士，CFA。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师，瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部总监，现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币市场基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。
陆丛凡先生，硕士。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益定量分析师，2015年4月加入海富通基金管理有限公司，2017年2月起任海富通上证周期产业债ETF的基金经理助理。
投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理兼固定收益投资总监；杜晓海，量化投资部总监；王金祥，研究部总监；陈轶平，固定收益投资副总监；赵赫，年金投资部总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。
讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。
上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分　基金托管人

一、基本情况
名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号（邮政编码：200120）
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号（邮政编码：200120）
成立时间：1987年3月30日
注册资本：742.62亿元人民币
法定代表人：彭纯
基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]25号
联系人：陆志俊
电　话：95559

第三部分　相关服务机构

一、基金份额发售机构
1、申购赎回代理券商（简称"一级交易商"）
（1）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：周杰
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
客户服务电话：95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com
（2）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
法定代表人：杨德红
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29F
客户服务电话：95521
联系人：钟伟镇
网址：www.gtja.com
（3）东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
法定代表人：潘鑫军
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
客户服务电话：95503
联系人：胡月茹
网址：www.dfzq.com.cn
（4）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
客户服务电话：95523或4008895523
联系人：陈飙
网址：www.swhysc.com
（5）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：韩志谦
办公地址：新疆乌鲁木齐高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
客户服务电话：4008000562
联系人：王怀春
网址：www.hysec.com
（6）中泰证券股份有限公司
注册地址：济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
客户服务电话：95538
联系人：许曼华
网址：www.zts.com.cn
（7）中信证券股份有限公司
注册地址：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
法定代表人：张佑君
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
客户服务电话：95548
联系人：王一通
网址：www.cs.ecitic.com
（8）中信证券(山东)有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：姜晓林
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
客户服务电话：95548
联系人：刘晓明
网址：www.zxwt.com.cn
（9）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话：95536
联系人：周杨
网址：www.guosen.com.cn
2、二级市场交易代理券商
包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。
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销售本基金，并及时公告。
二、登记结算机构
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
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：021-58872625
传真：021-68870311
联系人：刘永卫
三、出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
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
经办律师：孙睿、陈颖华
四、审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：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：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：李丹
经办注册会计师：薛竞、都晓燕
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：都晓燕

第四部分　基金的名称

本基金的名称：上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金。

第五部分　基金的类型

基金类型：交易型、开放式

第六部分　基金的投资目标

本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%，年化跟踪误差不超过3%。

第七部分　基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。
为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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。
在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。

第八部分　基金的投资策略

一、投资策略
（一）分层抽样策略
本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。
分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券中抽取若干成份券构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，进一步减少了组合维护及再平衡的所需的费用。
本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率进行分析，初步选择流动性较好的成份债券作为备选，其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体所属行业等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。
由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重和债券品种与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。
（二）替代性策略
当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。
替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
（三）债券投资策略
对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。
（1）久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。
（2）收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。
（3）类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。
（四）资产支持证券投资策略
对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。
（五）衍生品投资
未来，如法律法规或监管机构允许基金投资于其他与利率、标的指数、标的指数成份债券或构成基金组合的其他非成份债券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等，以及其他投资品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金进行衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪业绩比较基准，以便更好地实现基金的投资目标。
二、投资管理体制和程序
1.决策依据
有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。
2.投资管理体制
本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。
3.投资程序
研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。
（1）研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。
（2）投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。
（3）组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以抽样复制标的指数成份债券及成份债券权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。
（4）交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。
（5）投资绩效评估：定量研究团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。
（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份债券基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。
基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

第九部分　基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准即标的指数，上证周期产业债指数。
上证周期产业债指数由中证指数有限公司编制及发布，指数样本由交易所市场和银行间市场上市的，剩余期限1个月以上，行业为能源、材料、工业、公用事业、信息技术和可选消费等行业的公司债和信用债券样本组成，为债券投资者提供新的投资标的。
如果中证指数有限公司变更或停止上证周期产业债指数的编制及发布，或者上证周期产业债指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证周期产业债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，通过适当的程序变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并同时更换本基金的基金名称。若标的指数和业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

第十部分　基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证周期产业债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

第十一部分　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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月21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止至2018年6月30日（"报告期末"）。
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	固定收益投资	203,946,829.30	96.55
	其中：债券	203,946,829.30	96.55
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	1,000,000.00	0.47
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	388,298.39	0.18
7	其他资产	5,897,392.32	2.79
8	合计	211,232,520.01	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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	2,718,359.50	1.29
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	201,228,469.80	95.45
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	203,946,829.30	96.74

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

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	136377	16泰玻债	50,000	4,893,500.00	2.32
2	124345	PR京煤债	70,000	4,226,600.00	2.00
3	136217	16新有色	40,020	3,980,389.20	1.89
4	136150	16桐昆01	30,640	3,043,164.80	1.44
5	122591	12常交债	30,000	3,041,400.00	1.44

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股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。
10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。
10.2 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。
10.3 本期国债期货投资评价
根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。
11 投资组合报告附注
11.1报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,103.72
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	5,869,305.60
5	应收申购款	–
6	其他应收款	22,983.00
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	5,897,392.32

11.4 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。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

第十二部分　基金的业绩

基金业绩截止日为2018年6月30日。
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。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。
一、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
2017年1月23日（基金合同生效日）-2017年12月31日	2.94%	0.04%	-0.86%	0.04%	3.80%	0.00%
2018年1月1日-2018年6月30日	1.11%	0.07%	-2.14%	0.10%	3.25%	-0.03%
2017年1月23日（基金合同生效日）-2018年6月30日	4.08%	0.05%	-2.98%	0.07%	7.06%	-0.02%

二、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年1月23日至2018年6月30日)

注：本基金合同于2017年1月23日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

第十三部分　基金费用与税收

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、基金的指数许可使用费；
4、基金上市费及年费；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
二、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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.30%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.1%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。
3、基金合同生效后的指数许可使用费
本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。
在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。
计算方法如下：
H=E×0.02%÷当年天数
H为每日应付的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值
自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费按季支付。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定，指数许可使用费的收取下限为每季人民币25,000元（即不足25,000元部分按照25,000元收取）。但基金合同生效当季，基点费不设下限，按实际计提的金额收取。
如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。
上述"一、基金费用的种类"中第4－10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
三、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1、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；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
四、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分　对招募说明书更新部分的说明

上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书依据《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要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：
一、"第一部分　绪言"部分，增加了《流动性规定》的相关信息；
二、"第二部分　释义"部分，增加了对部分词语或简称的解释；
三、"第三部分　基金管理人"部分：
1.增加了杨仓兵先生的简历。
2.更新了任志强先生、Marc Bayot（巴约特）先生、张馨先生、俞涛先生、章明女士、奚万荣先生、陶网雄先生、陈轶平女士的简历。
3.删除了李础前先生、陈虹女士的简历。
4.更新了投资决策委员会的相关信息。
5.更新了基金管理人内部控制制度相关信息。
四、"第四部分　基金托管人"部分，更新了基金托管人的相关信息。
五、"第五部分　相关服务机构"部分：对部分场外销售机构的相关信息进行了更新。
六、"第十部分　基金份额的申购与赎回"部分，更新了申购与赎回的数量限制、拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方法的相关信息。
七、"第十一部分　基金的投资"部分，更新了投资限制的相关信息，并根据2018年第二季度报告，更新了基金投资组合报告的内容，相关数据截止期为2018年6月30日。
八、"第十二部分　基金的业绩"部分，根据2018年第二季度报告，更新了基金业绩的内容，相关数据截止期为2018年6月30日。
九、"第十四部分　基金资产的估值"部分，更新了暂停估值的情形相关信息。
十、"第十八部分　基金的信息披露"部分，更新了"公开披露的基金信息"的相关信息。
十一、"第十九部分 风险揭示"部分，增加了流动性风险评估方面的相关内容。
十二、"第二十二部分　基金托管协议的内容摘要"部分，更新了基金托管人的基本信息及"二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查"中的相关信息。

海富通基金管理有限公司
2018年9月5日

海富通基金管理有限公司关于海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构的公告

一、海通证券股份有限公司（以下简称"海通证券"）的开放式基金销售资格已获中国证券监督管理委员会批准。根据海富通基金管理有限公司日前与海通证券签署的开放式证券投资基金销售协议，现增加海通证券为海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金（简称：海富通欣益混合A，基金代码：519222；简称：海富通欣益混合C，基金代码：519221）的销售机构。
投资者欲了解基金的详细信息，请仔细阅读《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》及相关法律文件。
二、自2018年9月6日起，投资者可以在海通证券各网点办理上述开放式基金的开户、申购、赎回等业务。具体的业务流程、办理方式和办理时间等以海通证券的规定为准。
三、投资者可通过以下途径咨询有关详情：
1、海通证券股份有限公司
客户服务电话：95553
网站：www.htsec.com
2、海富通基金管理有限公司
客户服务电话：40088-40099（免长途话费）
网站：www.hftfund.com
本公告的解释权归海富通基金管理有限公司。
特此公告。

海富通基金管理有限公司
2018年9月5日

海富通基金管理有限公司关于上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金新增光大证券为销售机构的公告

光大证券股份有限公司（以下简称"光大证券"）的开放式基金销售资格已获中国证券监督管理委员会批准。根据海富通基金管理有限公司日前与光大证券签订的开放式证券投资基金销售协议，现增加光大证券为上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：10年地债；网上现金认购代码：511273；二级市场交易代码：511270）的销售机构。
投资者欲了解基金的详细信息，请仔细阅读《上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及相关法律文件。
一、自2018年9月6日起，投资者均可在光大证券各网点办理上述开放式基金的开户、认购等业务。具体的业务办理规则以光大证券的规定为准。
二、投资者可通过以下途径咨询有关详情：
1.光大证券网站：www.ebscn.com
光大证券咨询电话：95525
2.海富通基金管理有限公司网站：www.hftfund.com
海富通基金管理有限公司全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）
本公告的解释权归海富通基金管理有限公司。

海富通基金管理有限公司
2018年9月5日