准经营的其他业务。

组织形式:股份有限公司

存续期间: 持续经营

一)主要人员情况

三)基金托管业务经营情况

注册资本: 293.52亿元人民币

联系电话:(021)61618888

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

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

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

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、根募证券投资基金托管、私募股权托管、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

高桥保税区开发(控股)公司总经理:上海外高桥保税区管委会副主任:上海万国证

券公司代总裁;上海久事公司总经理;上海市城市建设投资开发总公司总经理;中国

上海浦东发展银行是安安风、1917下、37755年,上海宣东发展银行党委副书记、副董事长、行长。 孔建,男,1968年出生,博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员,国际业务部、工商信贷处科长、资金营运处副处长,上海浦东发展银行济南

分行信管外总经理,上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长、

截止2018年9月30日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为3319.68亿元,比去年末增加17.82%。托管证券投资基金共一百三十四只,分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、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、长信利众债券基金

建立、以同立列起另建立、海关队员正址建立、国际交员印建立、以同列众仍分建立 (LOF)、ປェ富保本混合型证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、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、汇添富双利

增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产

金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、金鹰改革红利基

金、易方达裕祥回根债券基金、国联安鑫福基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券

基金、「富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投资溢混合型证券投资基金、工银 瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、

君信混合基金、汇添富保鑫保金保合基金、、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怕纯债债券基金、中

加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞3个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开

债券基金、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、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰景益灵活配置混

合基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普

益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工

银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混

合基金。汇安沪深300指数增强型证券投资基金。汇安丰恒混合基金。交银施罗德启

通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500指数基金、南方和利定开债券基

会、聰华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰

债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基

金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投

资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基

中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基

金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵

活配置混合基金、中金价值轮动灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金

基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、、前海开源景鑫灵活配置混合型证

券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活

配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置

混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、华富恒悦定期

开放债券型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐

利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券

投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆

前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合

吨债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金基金、中银中债3-5年

(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、监管部

]监管规则和本行规章制度,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,保证基金资产的安全和完整,确保业务活动信息的直实、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。总行风险监经部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工

具体管理实施机构,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

托管业务的决策、执行、监督全过程,渗透到各业务流程和各操作环节,覆盖到从事

务产托管各级组织结构、岗位及人员。 内部控制以防范风险、合规经营为出发占、各

等理理念,营造浓厚的内控文化氛围,使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员

工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度;建立严格完善的资产隔离和资产保管制度,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方案,定期组织灾餐

演练,建立重大事项报告制度;在基金运作办公区域建立健全安全监控系统,利用录

音、录像等技术手段实现风险控制;定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行 监控,通过专项/全面审计等措施实施业务监控,排查风险隐患。

我行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

(1)资产托管部设置核算监督岗位,配备相应的业务人员,在授权范围内独立

(3)对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等,采取人工监督

(1)基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果,采取定期和不定期报告形

使对基金管理人投资交易行为的监督职责,规范基金运作,维护基金投资人的合

(2)在日常运作中,凡可量化的监督指标,由核算监督岗通过托管业务的自动 处理程序进行监督,实现系统的自动跟踪和预警;

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违法操作,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。在规定期限内基金托管人再对

基金管理人违规事项进行复查,如果基金管理人对违规事项未予纠正,基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时,基金托管人

围 投资比例、投资限制等进行严格监督,及时提示基金管理人违规风险

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

3、内部控制制度及措施:本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产

具体内控措施包括:培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险

总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部

期农发行债券指数证券投资基金等。

项业务流程体现"内控优先"要求

(1)《中华人民共和国证券法》:

(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、政策的其他规定。

法权益,不受任何外界力量的干预;

4、监督结果的处理方式

2、监督内容

(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》::

金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫垚主题轮动混合基金

现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

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,

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

高国富,男,1956年出生,研究生学历,博士学位,高级经济师职称。曾任上海外

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2003]105号

保持较快增长 各项经营指标在股份制商业银行中外干较好水平

资产托管运营由心(今会即公由心)五个即能协会

基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

重要提示 本基金经2017年11月1日中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1964号文准

予募集注册,基金合同于2018年6月6日正式生效。 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和市场前景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 不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合 同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金 产品的风险收益特征 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,由于基金投资者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等。本基金是债券型基 金 属于证券投资基金中的较低风险的基金品种 其风险与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。投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对 干认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。 木基金单一投 资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或 者超过50%, 本基金不向个人投资者销售。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

本基金可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券,由此可能给基金净值带来更大的负面

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

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 华爾安根姆基亚奇问科基亚指导的明书编与,并经中国证监云核准。基亚合同 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,

说明书所载内容截止日为2018年12月5日,有关财务数据和净值表现数据截止日为 2018年9月30日(本招募说明书中的财务资料未经审计)。

一)基金管理人情况

名称:兴业基金管理有限公司 住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼

设立日期:2013年4月17日 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2013]288号

注册资本:12亿元人民币

存续期限:持续经营

股东名称 兴业银行股份有限公司 中海集团投资有限公司

总行信贷审查部总经理,兴业银行福州分行副行长,兴业银行济南分行行长,兴业银行基金业务筹建工作小组负责人,兴业银行总行基金金融部总经理,兴业银行总行 管理部总经理、兴业银行金融市场总部副总裁等职。现任兴业基金管理有限公 司董事长,兴业财富资产管理有限公司执行董事。

国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总 经理、党委委员,中海集团投资有限公司总经理

汤夕生先生,董事,硕士学位。曾任建设银行浦东分行办公室负责人,兴业银行 司总经理,兼任上海市基金同业公会第三届副会长。

长,国家体改委下属中华股份制咨询公司副总经理,中国证监会稽查局副局长、中国 证监会派出机构工作协调部主任、兼投资者教育办公室主任,中信建投证券股份有 限公司合规总监、监事会主席等职。

所长,兼任上海世界经济学会副会长,中国金融学会学术委员,中国国际金融学会理 事,中国国际经济关系学会常务理事,全国日本经济学会副会长,上海市人民政府参

门市、广安市和青岛市金融咨询决策专家委员,云南省政府经济顾问。

任、宋副王任、宋业联门、广州、西州、西州、大、宋业联门、广州、大、宋业联门、广州、 行行长等职。现任兴业银行总行资产管理部总经理。 杜海英女士、监事,硕士学位。曾任中海(海南)海盛船务股份有限公司发展部 科长、发展部副主任(主持工作)、发展部主任、中共中国海运(集团)总公司党校副 校长、集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、 中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董

金管理有限公司机构业务部副总经理, 兴业基金管理有限公司综合管理部副总经 理。现任兴业基金管理有限公司产品研发部总经理

兴业基金管理有限公司财富管理总部总经理。

工意及工,首宗长,本种子历。历江宋业银行后页首理印志总理功建、副总总建, 兴业银行广州分行副行长,兴业银行信用审查部总经理,兴业银行小企业部总经理, 兴业银行金融市场总部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理

行营销管理部总经理,兴业基金管理有限公司总经理助理,上海分公司总经理,上海 兴晟股权投资管理有限公司总经理,兴投(平潭)资本管理有限公司执行董事。现任

理,兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长、兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副级长 银行总行资产管理部总经理助理,兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基

债券研究员和基金经理助理,其中2015年5月至2016年8月担任国联安德盛增利证 券投资基金的基金经理助理,2015年5月至2015年12月担任国联安中债信用债指数 增强型发起式证券投资基金的基金经理助理,2016年3月至2016年8月担任国联安安稳保本混合型证券投资基金的基金经理助理。2016年9月加入兴业基金管理有限 公司,2017年1月19日起担任兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年5月9日起担任兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福益债券型证 券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年3月8日起担任兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理,2018年6月6日起 担任兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理,2018年6月27日起担 任兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

证不证绝版 中产度别开放员务量证券行业员金量基金星星。 熊伟先生,经济学硕士。10年证券行业从业经验。2008年7月至2009年4月,在华泰联合证券担任宏观分析师;2009年5月至2010年10月,在海通证券担任宏观分析师;2010年10月至2011年3月,在浙江敦和投资有限公司担任投资经理助理;2011年 3月至2013年3月,在光大证券担任债券分析师;2013年3月至2014年4月,在浦银安 盛基金管理有限公司担任专户投资经理,从事债券投资及研究工作。2014年4月加 人兴业基金管理有限公司,2016年6月30日起担任兴业聚全灵活配置混合型证券投 资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年7月13日起担任兴

-年定期开放债券型证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金基金经理,2018 年8月7日起担任兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 5、投资策略委员会成员

汤夕生先生,总经理。 黄文锋先生,副总经理。 周鸣女士,固定收益投资一部总监。 冯小波先生,固定收益投资二部总经理

徐莹,固定收益投资二部副总经理兼投资总监。 腊博,固定收益投资一部投资总监。

版子越先生,研究部总经理助理兼海外投资部(筹)投资总监。 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。 、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: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、代理允付、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;提供保险箱业务;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;外沿

太平洋保险(集团)股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会 委员,中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员,上海交通大学安泰经济 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,上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理, 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

应详细查阅基金合同。 本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募

办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼 法定代表人:卓新章

组织形式:有限责任公司

联系电话:021-22211888 联系人:郭玲燕股权结构:

二)主要人员情况

卓新音先生,董事长,本科学历。曾任兴业银行宁德分行副行长,行长,兴业银行

明东先生,董事,硕士学位。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输 (集团)总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作,历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表,中国远洋运输(集团)总公司/中

上海分行南市支行行长,兴业银行上海分行副行长等职。现任兴业基金管理有限公 朱利民先生,独立董事,硕士学位。曾任国家体改委试点司主任科员、副处长、处

黄泽民先生,独立董事,博士学位。曾任华东师范大学商学院院长,第十届、十一十二届全国政协委员等职。现任华东师范大学终身教授、博导、国际金融研究所

曹和平先生,独立董事,博士学位。曾任中共中央书记处农研室国务院农村发展 研究中心农业部研究室副主任,北京大学经济学院副院长,云南大学副校长,北京大学供应链研究中心主任,北京大学中国都市经济研究基地首席专家等职。现任北京 大学经济学院教授(博士生导师),北京大学环境、资源与发展经济学创系主任,兼任北京大学数字中国研究院副院长,中国经济规律研究会副会长,中国西部促进会 副会长,中国环境科学学会绿色金融分会主任,中央电视台财经频道评论员,北京大学供应链研究中心顾问,互联网普惠金融研究院院长,广州市、西安市、哈尔滨市、厦 2、监事会成员

饭工平宏队公 碗工平先生,监事会主席,硕士学位。曾任上海农学院农业经济系金融教研室主 ,系副主任,兴业银行上海分行副行长,兴业银行天津分行行长,兴业银行广州分

李骏先生,即丁监事,硕士学位,曾任淯打银行全球金融市场部主任,海宫诵基

寿保险股份有限公司稽核审计部助理总经理 海宫通基金管理有限公司监察稽核部

稽核经理、财务部高级财务经理,兴业基金管理有限公司监察稽核部副总经理。现任 卓新章先生,董事长,简历同上。

并列车从上,当季下,同公司工。 汤夕生先生,总经理,简历同上。 王慧女士,督察长,本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理,

发 可免安安员、自宗长。 黄文锋先生,副总经理,硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美 支行行长、兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理、兴业银行厦门分行党委委员、行长助理、兴业银行总行投资银行部副总经理、兴业银行沈阳分行 党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理

是安安以、即引入。。然正不显著亚自是市限公司是安安以、即志至是。 张顺国先生,副总经理,本种学历。历任秦阳证券上海管理总部总经理助理,深 圳发展银行上海分行金融机构部副总经理,商人银行部副总经理,深圳发展银行上 海分行宝山支行副行长,兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分

兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。 庄孝强先生,总经理助理,本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经 金管理有限公司党委委员、总经理助理,兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行

。 4、本基金基金经理 徐青先生,硕士学位。7年证券从业经验。2011年7月至2014年1月,在华泰证券 股份有限公司研究所担任债券研究员,从事债券研究工作;2014年2月至2016年8月,在国联安基金管理有限公司债券组合管理部从事债券投资研究工作,期间担任

应立即报告中国证监会,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。

、相关服务机构 - )基金份额发售机构 (1)名称:兴业基金管理有限公司直销中心 住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼

法定代表人:卓新章 办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼

联系人:张龄枫

传直:021-22211997

网址:http://www.cib-fund.com.cn 2. 其他销售机构

整销售机构的相关公告。 名称·兴业基金管理有限公司

住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼

办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼 法定代表人:卓新章

联系电话:021-22211899

三)出具法律意见书的律师事务所 名称: 上海市涌力律师事务所 住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 办公场所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

电话:021-31358666

联系人:陈颖华

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

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) 主要经营场所:上海市延安东路222号外滩中心30楼

执行事务合伙人: 曾顺福

电话:021-6141 8888 传真:021-6335 0177/0377

联系人:曾浩 经办注册会计师:曾浩、吴凌志

四、基金的名称 兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

五、基金的类型 债券型证券投资基金 六、基金份额的封闭期和开放期

一) 基金的封闭期 本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日(不含该 日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期 内不办理申购与赎回等业务,也不上市交易。

一) 基金的开放期 本基金每3个月开放一次,每次开放期最长不超过20个工作日,每个开放期的首 日为基金合同生效日所在月份在后续每3个日历月中最后一个日历月的第一个工作

开放期的具体时间以基金管理人居时公告为准 日基金管理人最迟应于开放期 开始前2日进行公告。如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回等业务的,或依据基金合同需暂停申购或赎回等业务 的,开放期时间顺延,直至满足开放期的时间要求,具体时间以基金管理人届时公告

假设基金合同生效日为2017年9月11日。则基金合同生效日所在月份在后续每 3个日历月中最后一个日历月期为2017年12月,2018年3月,2018年6月,2018年9月 等等(以此类推)。2017年12月1日为工作日,则本基金第一个开放期的首日为2017 年12月1日。开放期最长不超过20个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公 告为准,则基金管理人最迟应于开放期开始前2日(即2017年11月29日)进行公告。

七、基金的投资目标 本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获 得超越业绩比较基准的收益。

八、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,包括国债、央行票据、金融 债、地方政府债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、短期融资券、中期票据、资产 支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、同业存单、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 本基金不直接买人股票或权证,不可投资可转换债券及分离交易可转债上市后

分离出来的债券。 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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资

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%;但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前10个 工作日至开放期结束后10个工作日内,基金投资不受前述比例限制。开放期内,基金 持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内, 本基金不受上述5%的限制。

力、基金的投资策略

(一)基金的投资策略 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略

(1)资产配置策略 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

政策和财政政策及资金供需情况的研究,把握大类资产的预期收益率、利差水平、风 险水平,在有效控制风险的基础上,动态调整基金大类资产的投资比例,力争为基金 本基金将通过宏观经济变量和宏观经济政策等进行定性及定量分析,在考虑封

闭期剩余期限的基础上,进而对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断。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

(3)信用债券投资策略 信用类债券是本基金重要投资标的,信用风险管理对于提高债券组合收益率至 关重要。本基金将根据宏观经济运行状况,行业发展周期,公司业务状况,公司治理 结构、财务状况等因素综合评估信用风险,确定信用类债券的信用风险利差,有效管 理组合的整体信用风险。同时,本基金将运用本基金管理人比较完善的信用债券评 级体系,对信用债券发行人基本面的深入调研分析,结合流动性、信用利差、信用证 级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产 品进行投资。

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异,债券资产有必要配 置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置,以寻求收益性、流动性和信

风险收益相匹配的券种,建立具体的个券组合。

(4)类属配署策略

用风险补偿间的最佳平衡点。本基金将综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构 等因素分析的结果来决定投资组合的类别资产配置策略。 本基金根据债券市场收益率水平,在综合考虑债券的信用评级、流动性、息票 率、税赋等因素的基础上,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在确定债券

组合久期之后,本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析,结合税收差

异、信用风险分析、利差分析以及交易所流动性分析,判断个券的投资价值,以挑选

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 风险可挖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。 (7)资产支持证券的投资策略

评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能 的提高本基金的收益。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散

投资,以降低流动性风险。
(8)中小企业私募债券投资策略 与传统的信用债相比,中小企业私募债券普遍具有高风险和高收益的显著特。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析,着重分析发行人的企业性质、 所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而预测信用

水平的变化趋势,决定投资策略。 2、开放期投资策略 吴持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基 开放期内, 本基金为 一方成例行,不整显为保持权同的3自己的成员正,万度及员人女指议员,在逐步平整 金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。

二)基金的投资管理流程

(1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定; (2)以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则; (3)国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及

2. 投资管理程序 1)备选库的形成与维护

对于债券投资。分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断、采用利 率模型、信用风险模型及期权调整利差(OAS)对普通债券和含权债券进行分析,在 托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据 此基础上形成基金债券投资的信用债备选库。 本基金管理人定期召开资产配置会议, 讨论基金的资产组合以及个股配置,形

成资产配置建议。 (3)构建投资组合 投资策略委员会在基金合同规定的投资框架下,审议并确定基金资产配置方

案,并审批重大单项投资决定 基金经理在投资策略委员会的授权下,根据本基金的资产配置要求,参考资产 配置会议、投研会议讨论结果,制定基金的投资策略,在其权限范围进行基金的日常

(4)交易执行 基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室 发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况

(5)投资组合监控与调整 基金经理负责向投资策略委员会汇根基金投资执行情况,监察稽核部对基金投资进行日常监督,风险管理员负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理定期

对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估,对基金投资组合不断进

十、基金的业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数收益率

中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围更加全面,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场,交易 所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中国债券综合全价指数各项指标值 的时间序列更加完整,有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念,本基金选择市场

认同度较高的中国债券综合全价指数的收益率作为业绩比较基准。 如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较 基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,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,而无需召开基金份额持有人大会。 十一、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,其预期风险

与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 十二、基金投资组合报告 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。 基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,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、

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

	其中:股票	_	_
2	基金投资	-	_
3	固定收益投资	2,794,377,558.10	97.00
	其中:债券	2,794,377,558.10	97.00
	资产支持证券	-	_
4	贵金属投资	-	_
5	金融衍生品投资	-	_
6	买人返售金融资产	29,450,164.18	1.02
	其中: 买断式回购的买人返售 金融资产	-	_
7	银行存款和结算备付金合计	12,487,307.58	0.43
8	其他资产	44,583,877.49	1.55
9	合计	2,880,898,907.35	100.00

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

木基全木报告期末未持有股票.

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。

债券名称

常城

7电投01

4 报告期	<b>不按债券品种分类的债券</b>	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	389,075,000.00	19.08
	其中:政策性金融债	319,388,000.00	15.66
4	企业债券	1,394,873,558.10	68.40
5	企业短期融资券	564,200,000.00	27.67
6	中期票据	446,229,000.00	21.88
7	可转债(可交换债)	-	
8	同业存单	-	_
9	其他	-	-

2,794,377,558.10

公允价值(元)

121 128 000.0

99,688,600.0

·基金资产净值

5.94

4.89

比例(%)

1,002,500 041759027 91,053,000.0 900,000 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

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

2 000 00

1 200 000

1.000.00

数量(张)

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

序号

债券代码

041800193

143114

136304

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

本基金投资范围不包含股指期货

本基金投资范围不包含股指期货 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金投资范围不包含国债期货

本基金投资范围不包含国债期货。 10.3 本期国债期货投资评价 本基金投资范围不包含国债期货

应收股利

十二、基金的业绩

11 投资组合报告附注 11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金

11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。 11.3 其他资产构成 151,013.43

投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一

其他应收款 44.583.877.49

本基金本报告期末未持有可转换债券。 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。

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较。 净值增长率 净值增长率 业绩比较基 阶段 能收益率标 1)-(3) (2)-(4)标准差② 住收益率3 准差④ 白基金台 生效日起至 0.46 -0.31% -0.04% 2018年6月 018年7月 至2018 1.309 0.07 -0.039 0.57 月30日 自基金合

30日 基金的过往业绩并不预示其未来表现。

-)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;

8、基金的开户费用和账户维护费;

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0.3%年费率计提。管理费的计算方法 H=E×0.3% ÷ 当年天数

E 为前一日的基金资产净值

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

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

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:

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。

承担纳税义务。因此,本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负,仍由本 基金财产承担,届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付, 或划付至管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。 十五、对招募说明书更新部分的说明 本招募说明书(更新)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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关

法律法规的要求,对本基金管理人于2018年4月24日刊登的《兴业3个月定期开放债 券型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新,并根据基金管理人在《基金合 司》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新,主要补充和更 1、在"重要提示"部分,补充了基金合同生效情况、招募说明书内容的截止日

2、在"一、绪言"部分,补充了基金合同生效情况。 3、在"三、基金管理人"部分,更新了主要人员情况。 4、在"四、基金托管人"部分,更新了托管人基本情况、主要人员情况、基金托

管业务经营情况。

5、在"五、相关服务机构"部分,更新了直销联系人的信息。 6、在"六、基金的募集"部分,更新了基金的募集情况。

8、在"十、基金的投资"部分,补充了基金投资组合报告的内容。 9、在"十一、基金的业绩"部分,补充了基金业绩表现的内容

兴业基金管理有限公司

投资明组 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 本基金本报告期末未持有贵金属。 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 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

10.1 本期国债期货投资政策 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

年内受到公开谴责, 外罚的情形

44,026,545.4

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 下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际

收益水平要低于所列数字。 基金业绩截止日为2018年9月30日,下述数据未经审计。

生效日起3 -0.02% 1.04 0.069 0.41% 2018年9月

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、仲裁费和诉讼费; 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;

H 为每日应计提的基金管理费

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5个工作日内从基金财 空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。 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

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5个工作日内从基金财 空中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

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。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中,可能因法律法规 脱收政策的要求而成为纳税义务人,就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金

期以及相关财务数据的截至日期。

7、在"七、基金合同的生效"部分,更新了基金合同生效情况。

10、在"二十三、其他应披露事项"部分,补充了基金管理人在招募说明书更新 期间刊登的与本基金相关的公告。

其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调

设立日期:2013年4月17日 联系人:金晨

误导性陈述或者重大遗漏. 本投资组合报告所载数据截至2018年第3季度报告,本报告中所列财务数据未

> 报告期末基金资产组合情况 占基金总资产的比例(%)