渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要

（2019年第1号）

【本基金不向个人投资者公开销售】

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
截止日：2019年6月28日

重要提示

本基金募集申请已于2017年6月29日获中国证监会证监许可〔2017〕1069号文《关于准予渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册。本基金的基金合同于2017年12月28日正式生效。

本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、市场前景和收益等作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

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，全面了解本基金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，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，投资者申购、赎回失败的风险，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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并按监管要求履行相关程序。

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1.00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1.00元初始面值的风险。

基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中中低风险/收益特征的品种。

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。

本基金允许单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金总份额的50%。本基金不向个人投资者公开销售。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年6月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日（未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋 201室
办公地址：北京市西城区西直门外大街甲143号凯旋大厦A座2层
成立日期：2016年5月18日
法定代表人：徐海军
联系电话：0755-33017781
传真：0755-33017781
注册资本：11亿元人民币
联系人：魏文婷
股权结构：

股 东	出资额（万元人民币）	出资比例（%）
渤海证券股份有限公司	110,000	100
合 计	110,000	100

经营范围：证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务

二、主要人员情况

1、董事会成员基本情况

徐海军先生，董事长，南开大学法学硕士。1996年参加工作，历任南方证券天津解放路营业部业务员、南方证券天津分公司资产保全部副经理；2001年3月至2007年6月，任渤海证券股份有限公司法律事务部经理、北京总部总经理等职；2007年6月至2017年6月，任渤海证券股份有限公司合规总监、首席风险官兼风险控制总部总经理；2017年7月至2017年9月任渤海证券股份有限公司合规总监、财务总监；2017年9月至今任渤海证券股份有限公司财务总监。

邱晓敏女士，董事、副总经理兼市场总监，中央财经大学金融学硕士。逾15年证券从业经历，10年资产管理业务经验。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部副总经理兼营销总监；2014年3月起，任渤海证券股份有限公司基金管理总部副总经理（主持工作）。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理兼市场总监。

赵颖女士，董事，南开大学工商管理硕士。2011年进入渤海证券股份有限公司任人力资源总部总经理；2012年11月至2015年4月，任渤海证券股份有限公司研究所所长兼人力资源总部总经理；2015年4月至2018年8 月，任渤海证券股份有限公司人力资源总部总经理；2017年9月份起，任渤海证券股份有限公司债券融资总部总经理；2017年12月至2018年10月，兼任渤海证券股份有限公司债权业务总监；2016年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事。

刘婧女士，董事、合规总监，大连海事大学法学硕士。2001年进入渤海证券股份有限公司，逾15年证券业法务与风险管理经验。2001年起历任渤海证券股份有限公司总裁办法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、风险控制总部副总经理、公司首席律师；2015年6月起，任渤海证券股份有限公司法律合规总部经理；2017年9月至2018年9月，任渤海证券股份有限公司合规总监兼合规管理总部总经理。2018年9月起，任渤海证券股份有限公司合规总监兼合规管理总部总经理。2016年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监。

2、监事基本情况

刘彤先生，监事，南开大学工商管理硕士。2002年7月进入渤海证券股份有限公司，曾担任渤海证券股份有限公司法律合规总部副总经理兼合规管理一部经理、公司律师。2018年9月起，任渤海证券股份有限公司合规管理总部副总经理。2017年5月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司监事。

3、高级管理人员基本情况

邱晓敏女士，董事、副总经理兼市场总监，中央财经大学金融学学士。逾15年证券从业经历，10年资产管理业务经验。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部副总经理兼营销总监；2014年3月起，任渤海证券股份有限公司基金管理总部副总经理（主持工作）。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理兼市场总监。

周里勇先生，副总经理兼财务负责人，南开大学经济学学士、中国人民大学工商管理硕士。从事证券投资研究及相关领域的管理工作近二十年，实践经验非常丰富。2010年起进入渤海证券股份有限公司任证券投资总部负责人。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理、先后兼任投资一部总经理、证券投资部总经理；2017年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司财务负责人。2018年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事会秘书。

刘婧女士，董事、合规总监，大连海事大学法学硕士。2001年进入渤海证券股份有限公司，逾15年证券业法务与风险管理经验。2001年起历任渤海证券股份有限公司总裁办法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、风险控制总部副总经理、公司首席律师；2015年6月起，任渤海证券股份有限公司法律合规总部总经理；2017年9月至2018年9月，任渤海证券股份有限公司合规监兼法律合规管理总部总经理。2018年9月起，任渤海证券股份有限公司合规监兼合规管理总部总经理。2016年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监。

李颖女士，首席风险官，天津财经学院会计系国际会计专业毕业，在职攻读南开大学金融系金融学专业研究生，获取硕士学位。本科毕业后在天津会计师事务所（后改制为天津津源会计师事务所、五洲联合会计师事务所）从事审计，任项目经理、部门经理、报告终身复核人。2001年进入渤海证券股份有限公司，历任财务总部总经理助理、副总经理、总经理；2015年3月，任渤海证券股份有限公司财务负责人；2017年7月起，任渤海证券股份有限公司首席风险官兼风险控制总部总经理。2017年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司首席风险官。

4、本基金拟任基金经理

李杨女士，天津财经大学国际经济与贸易学士。2011年9月至2014年4月就职于包商银行金融市场部，任债券交易员。2014年5月至2016年8月就职于天津银行金融市场部，任债券交易员。2016年9月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任基金经理。

5、投资决策委员会成员

主任委员：
屈艳霞女士，副总经理，简历同上。
委员：
何翔先生，公募投资总监。南开大学数学学士、金融学硕士。2013年10月至2016年8月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016年8月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，现任公募投资总监、公募投资部经理。
李杨女士，基金经理，简历同上。
张研女士，风险控制部风控经理，西南财经大学本科。具有10年以上证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2007年—2015年曾在新时代证券财务部任职。2015年内调到新时代证券的风险控制部，主要负责资产管理业务的风控阈值管理、合同文本审核和主动管理型产品立项审核。2017年4月份加入渤海汇金证券资产管理有限公司，负责公募基金风险控制管理工作。
陈天彤女士，助理研究员。英国剑桥大学金融经济学硕士，4年证券从业经验，具有中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2015年5月至2016年8月就职于渤海证券，任助理研究员；2016年8月至今就职于渤海汇金证券资产管理有限公司，任助理研究员。
6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况

（一）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)。

2018年6月末，本集团资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315余人。自2007年起，托管部走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。

（二）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。具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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

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。

原订，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。

（三）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2018年二季度末，中国建设银行已托管近57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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”，连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”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”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构：
名称：渤海汇金证券资产管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋 201室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
成立日期：2016年5月18日
法定代表人：徐海军
传真：0755-33017781
联系人：谭如娜
联系电话：022-23961525
客服电话：400-651-5988,400-651-1717
网址：https://www.bhhjamc.com

2、其他销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

二、登记机构

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋 201室
办公地址：深圳市南山区海岸大厦西座2901、2913室
法定代表人：徐海军
联系电话：010-68784295
传真：010-68784289
联系人：魏文婷
网址：https://www.bhhjamc.com

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
注册地址：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：陆奇
经办律师：安冬、陆奇

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：中国上海自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：中国北京朝阳区东三环中路7号财富中心A座26层
法定代表人：李丹
电话：010-65338888
经办注册会计师：李轶英、朱辉
联系人：朱辉

第四部分基金的名称

本基金名称：渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

第五部分基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金。

第六部分基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。

第七部分基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券、可分离债券的纯债部分、可交换债等）、资产支持证券、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）、同业存单等货币市场工具，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）。

本基金不主动买入股票、权证等权益类资产，投资可转换债券、可交换债时不进行转股操作。

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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产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，在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。

开放期每个交易日日终，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。

第八部分基金的投资策略

本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。

1、利率预期策略与久期管理

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向，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，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置，主要有期限结构策略以及息差策略两种。

（1）期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

1）骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

2）子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分别于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

（2）息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。本组合将采取低杠杆、高流动性策略，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。

2、类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管 理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

3、信用债券投资策略

本基金将重点投资于企业债、公司债、金融债、地方政府债、短期融资券、中期票据、可转换债券、可分离债券的纯债部分、资产支持证券等信用债券，以提高组合收益率。

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面对收益率曲线的判断以 及对信用债整体信用利差研究的基础上，确定信用债总体的投资比例。考量信用 利差的整体变化趋势；另一方面，本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评 级为辅，即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本 面，以确定企业主体债的实际信用状况。本基金的信用债投资策略主要包括行业配置策略以及个券挖掘策略两个方面。

（1）行业配置策略。债券市场所涉及行业众多，同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生，本基金分别采用以下的分析策略：

分散化投资：发行人涉及众多行业，本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构，避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。

行业投资：本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判，确定在下一阶段在各行业的配置比例，卖出景气度降低行业的债券，提前布局景气度提升行业的债券。

（9）个券挖掘策略

本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。

（10）中小企业私募债券投资策略

本基金将根据审慎原则投资中小企业私募债。本基金以持有到期中小企业私募债为主，以获得本金和票息收入为投资目的，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。

2、开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基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。

§9 投资决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、研究员、交易员在投资管理过程中责任明确、密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下：

（1）投资决策委员会审议投资策略、资产配置和其它重大事项；

（2）投资部门通过投资例会等方式讨论投资的个券，研究员提供研究分析与支持；

（3）基金经理根据所管基金的特点，确定基金投资组合；

（4）基金经理发送投资指令；

（5）交易部审核与执行投资指令；

（6）数量分析人员对投资组合的分析与评估；

（7）基金经理对组合的检讨与调整。

在投资决策过程中，风险管理部门负责对各决策环节的事前及事后风险、操作风险等投资风险进行监控，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员，以供决策参考。

§10 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，指数样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券等固定收益资产来获取的收益，力争获取相对稳健的绝对回报，追求委托财产的保值增值。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能客观合理地反映本基金投资收益特征。

若未来法律法规发生变化，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，或者本基金业绩比较基准停止发布，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在不损害基金份额持有人利益的前提下，经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。

§11 风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

§12 基金投资组合报告

招商添利6个月定期开放债券型发起式证券投资基金管理人－招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日，来源于《招商添利6个月定期开放债券型发起式证券投资基金2019年第1季度报告》。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,938,440,000.00	96.60
	其中：债券	2,938,440,000.00	96.60
	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	49,409,597.85	1.62
8	其他资产	54,133,685.92	1.78
9	合计	3,041,983,283.77	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

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

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	202,012,000.00	6.64
	其中：政策性金融债	202,012,000.00	6.64
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	694,536,000.00	22.84
6	中期票据	1,800,241,000.00	59.21
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	241,651,000.00	7.95
9	其他	–	–
10	合计	2,938,440,000.00	96.64

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	111819319	18恒丰银行CD319	2,000,000	192,940,000.00	6.35
2	101560061	15陕煤化MTN003	1,300,000	133,237,000.00	4.38
3	101801155	18天津轨交MTN001	1,000,000	101,630,000.00	3.34
4	101554054	15中建八局MTN002	800,000	81,816,000.00	2.69
5	180312	18进出12	800,000	80,224,000.00	2.64

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

9.2 本基金投股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，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

根据本基金合同规定，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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11 投资组合报告附注

11.1

报告期内基金投资的前十名证券除15中建八局MTN002（证券代码101554054）、17陕西能源MTN002（证券代码101760036）、18陕交建MTN002（证券代码101800975）、18陕投集团CP001（证券代码041800079）、18太钢MTN003（证券代码101801279）外其他证券的投资决策程序均符合现行法律法规，或监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、15中建八局MTN002（证券代码101554054）

该证券发行人在报告期内因环境污染、未依法履行职责、涉嫌违反法律法规、产品不合格等原因多次收到监管机构的处罚决定。

2、17陕西能源MTN002（证券代码101760036）

根据2018年8月27日发布的相关公告，该证券发行人因违规使用募集资金、未及时披露公司重大事件，被陕西证监局警示。

3、18陕交建MTN002（证券代码101800975）

根据2019年1月2日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营，被陕西省审计厅责令改正。

4、18陕投集团CP001（证券代码041800079）

根据2018年8月27日发布的相关公告，该证券发行人因违规使用募集资金、未及时披露公司重大事件，被陕西证监局警示。

5、18太钢MTN003（证券代码101801279）

根据2018年4月16日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责，被海口市地税局美兰区地税局处以罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

11.2

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	54,133,685.92
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	54,133,685.92

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。

§13 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财产，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

招商添利6个月定开债发起式A：

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
2018.06.27-2018.12.31	3.00%	0.05%	4.63%	0.06%	-1.63%	-0.01%
2019.01.01-2019.03.31	1.29%	0.04%	1.42%	0.06%	-0.13%	-0.02%
自基金成立起至2019.03.31	4.33%	0.05%	6.13%	0.06%	-1.80%	-0.01%

注：本基金合同生效日为2018年6月27日。

本基金C类份额从成立至报告期末未有资金进入，仅披露本基金A类份额的情况。

§14 基金的费用与税收

14.1 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、基金销售费用；
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；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、基金相关账户的开户及维护费用；
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。

14.2 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，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、公休假等，支付日期顺延。本基金在开放期内不收取管理费。

2、基金托管人的托管费

除开放期外，本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%－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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内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。本基金在开放期内不收取托管费。

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。

二、与基金销售有关的费用

（一）申购费

本基金申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

（1）本基金采用金额申购方式，基金份额的申购费率如下表：

单次申购金额M	申购费率
M＜100万元	0.80%
100万元≤M＜300万元	0.50%
300万元≤M＜500万元	0.30%
M≥500万元	每笔500元

（2）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。

（二）赎回费

本基金采用份额赎回的方式，基金份额的赎回费率如下表：

持有期T	赎回费率
T＜7天	1.50%
7天≤T＜1个封闭期	0.30%
1个封闭期≤T	0.00%

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。赎回费全额计入基金财产。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调整申购费率、调低赎回费率并进行公告。

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

根据相关税收规定，自2018年1月1日起，证券投资基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征税率缴纳增值税。管理人将对本基金运营过程中产生的增值税及附加税费在基金财产中计提，并由管理人按照现行规定缴纳。具体公告见2017年12月29日基金管理人在公司网站发布的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下证券投资基金执行增值税政策的公告》。

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

本基金管理人依据《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，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于 2019 年2月1日公告的《渤海汇金汇添益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，主要更新的内容如下：

1.“重要提示”部分：明确了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。

2.“第三部分基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。

3.“第十部分基金投资组合报告”部分：更新了本基金2019年第1季度投资组合报告内容。该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。

4.“第十一部分基金的业绩”部分：更新了自基金生效日至2019年3月31日的基金业绩，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。

5.“第二十三部分其他应披露事项”部分：列示了本基金2018 年12月29日至2019 年6月28日期间披露的涉及本基金及基金管理人的相关公告。

渤海汇金证券资产管理有限公司
二〇一九年八月九日

招商添利6个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2019年第2号）

基金管理人：招商基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
截止日：2019年06月27日

重要提示

招商添利6个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2017年12月26日《关于准予招商添利6个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】2401号文）注册公开募集。

本基金的基金合同于2018年6月27日正式生效。本基金为契