

中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书 更新 摘要

(2019年第1号)

(2016年3月23日至今)、中加丰润纯债债券型证券投资基金(2016年6月17日至今)、中加丰尚纯债债券型证券投资基金(2016年8月19日至今)、中加丰泽纯债债券型证券投资基金(2016年12月19日至今)、中加丰盈纯债债券型证券投资基金(2016年11月2日至今)、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金(2016年11月11日至今)、中加丰享纯债债券型证券投资基金(2016年11月11日至今)、中加丰裕纯债债券型证券投资基金(2016年11月28日至今)、中加顺颐定期开放债券型发起式证券投资基金(2016年6月8日至今)、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金(2019年1月17日至今)、中加顺颐纯债债券型证券投资基金(2019年4月29日至今)的基金经理。

5.投资决策委员会
投资决策委员会成员包括公司董事长夏英先生,总经理宗洁先生,副总经理魏忠先生,督察长刘向途先生,市场营销部副总监希琳女士,基金经理田洪贤先生、张旭先生、杨宇俊先生、康晓娟女士,投资研究部首席宏观研究员李继民先生,监察稽核部总监助理王雯雯女士。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。
(三)基金管理人职责
根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定,基金管理人应履行以下职责:
1.依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2.办理基金备案手续;
3.对所管理的不同基金财产分别管理,分别记账,进行证券投资;
4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6.编制季度、半年度和年度基金报告;
7.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;
8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9.按照约定召集基金份额持有人大会;
10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12.有关法律法规和中国证监会规定的其 他职责。
(四)基金管理人承诺
1.本基金管理人根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的资产。
2.本基金管理人从事违反《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生。
3.本基金管理人从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事内幕交易、操纵证券交易及其他不正当的证券交易活动;
(4)买卖其他基金、股票,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出借;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
4.本基金管理人将加强人力资源管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用,勤勉尽责,不从事以下行为:
(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)将基金财产份额用于违规承诺收益或者承担损失;
(5)侵占、挪用基金财产;
(6)泄露因职务便利获取的未公开信息,利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(7)玩忽职守,不按照规定履行职务;
(8)违反法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。
5.基金投资法律
(1)依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2)不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三人谋取利益;
(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者暗示、暗示他人从事相关的交易活动。
(4)不得以任何形式为其他组织或个人从事证券交易。
(五)基金管理人的内部控制制度
1.内部控制的原则
本基金管理人的内部控制遵循以下原则:
(1)全面性原则:内部控制应覆盖基金公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节,并普遍适用于公司每一位员工;
(2)独立性原则:公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位,并在相关部门建立防火墙;公司设立独立的风险管理部门和监察稽核部门,保持高度的独立性和权威性,分别履行风险管理和合规监察职能,并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查;
(3)审慎性原则:内部控制的核心是有效防范各种风险,任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;
(4)有效性原则:公司内部管理制度应具有高度的权威性,是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有例外行为,任何人不得拥有超越制度或违反制度的权力;
(5)及时性原则:内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合,充分利用电脑网络,建立电脑预警系统,保证监控的及时性;

(6)适时性原则:内部控制制度的制订应具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的变化及时对其进行相应的修改和完善;
(7)定量与定性相结合的原则:建立完备内部控制指标体系,使内部控制更具客观性和可操作性;
(8)成本效益原则:公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果;
(9)相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
(10)审慎性原则:公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》等相关法律法规的规定,按照合法合规、全面性、审慎性、适时性原则,建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1)公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。
(2)公司基本管理制度包括风险管理制度、监察稽核制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度及基金业务制度等。
(3)部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作规程等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度,并结合同部门职责和业务工作的要求制定。

3.完备严密的内部控制体系
公司独立建立的内部控制体系,董事会层面设立督察长,管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部门和风险管理部门,通过风险管理制度和监察稽核制度两个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系,对公司内部控制和风险管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈,保障公司内部控制机制的严格落实。
风险管理方面由董事会下设的风险管理委员会制定风险管理政策,由管理层的风险控制委员会负责实施,由风险管理部门专职落实和公司各业务部门制定相应的业务流程和风险管理政策,全面把握风险点,将风险管理责任落实到个人,实现对风险的日常管理和过程中管理,防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已发生的各种风险。
监察稽核制度由督察长的领导下严格执行,由监察稽核部门协助和配合督察长进行稽核监督。通过对公司日常业务各个环节的各个环节的合法合规性进行实时监控,监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度等的情况,识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规行为,提出并完善公司各项合规性制度,以充分维护公司客户的合法权益。通过检查公司内部管理制度、资讯管理、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工 作环节,对公司自我管理、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议,从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

4.基金管理人关于内部控制声明
公司明确建立内部控制控制系统,维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确,并承诺根据市场环境的变化和公司的发展不断完善风险管理 and 内部控制制度。
一、基金托管人基本情况
1.基本情况
名称:兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)
注册地址:福州市湖东路154号
办公地址:上海市银城路167号
法定代表人:高建平
成立时间:1988年8月22日
注册资本:207.74亿元人民币
存续期限: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[2006]74号
托管部联系人:刘微
电话:021-52629929
传真:021-62159217
2.发展概况及财务状况
兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月6日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本207.74亿元。
开业二十多年来,兴业银行始终坚守“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2019年6月30日,兴业银行资产总额62.71万亿元,实现营业收入1582.87亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润606.20亿元。

三、托管业务的内部控制措施及员工培训
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金业务处等处室,共有员工100余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。
四、基金托管业务经营情况
兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2019年6月30日,兴业银行共托管证券投资基金267只,托管基金资产净值合计10468.12亿元,基金份额合计10311.43亿份。
五、基金托管人的内部风险控制制度说明
1.内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监督,确保基金资产的稳健运行,保证基金资产的安全完整,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
兴业银行基金托管业务内部控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部业务处室共同组成。总行审计部对专项业务风险管控工作进行指导和监督;资产托管部内设独立、专职的稽核监察处,配备了专岗专门监督监管人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部控制原则
(1)全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
(2)独立性原则:风险控制工作应设立稽核监察处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
(3)相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制,建

立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和可操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6)有效性原则:内部控制体系同所处的环境相适应,以合理的成本实现内控目标,内部制度的制订应当具有前瞻性,并应当根据国家政策、法律及经营管理的要求,适时进行相应修改和完善;内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正;

(7)审慎性原则:内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关控制制度建设;

(8)责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

六、内部控制制度及措施
1.制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
2.建立健全的组织管理结构:前台后台分离,不同部门、岗位相互牵制。
3.风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。
4.相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。
5.人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。
6.应急预案:制定完备的应急预案,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

七、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
基金托管人负对基金管理人的投资运作行使监督权职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值计算、收益分配、申购赎回及其他有关基金投资和运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。
基金托管人发现基金管理人存在违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权就前述事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。
基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经发生或投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构
(一)基金份额发售机构
1.直销中心
本基金直销中心为基金管理人的直销柜台以及基金管理人的电子自助交易系统。
名称:中加基金管理有限公司
办公地址:北京市西城区南纬路35号
注册地址:北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室
法定代表人:夏英
全国统一客户服务热线:400-00-95626
传真:010-83197627
联系人:江丹
公司网站:www.bobhms.com
投资者可以通过基金管理人电子自助交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务。

2.基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时履行公告义务。
(二)登记机构
名称:中加基金管理有限公司
注册地址:北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室
办公地址:北京市西城区南纬路35号
法定代表人:夏英
全国统一客户服务热线:400-00-95626
(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:黎明、陈颖华
(四)审计基金资产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京长安街1号东方广场东 2座办公楼 8层
办公地址:中国北京长安街1号东方广场东 2座办公楼 8层
法定代表人:邹俊
经办注册会计师:李辉
电话:010-8508 7929
传真:010-8518 5111
联系人:曹哲铭

四、基金名称
本基金名称:中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金
五、基金的类型
基金类型:契约型开放式
六、投资目标
力争在严格控制投资风险的前提下,长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
七、基金的投资方向
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、证券公司短期公司债券) 资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款)和货币市场工具等其他金融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的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券和可交换债券。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%,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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、存出保证金及应收申购款等。
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。

八、基金的投资策略
本基金将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、国家产业政策和资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在信用债与利率债之间的配置比例。
1.久期策略
本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析,进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低利率变动对组合带来的影响。本基金管理人的固定收益团队将定期对利率期限结构进行预判,制定相应的久期目标,当预期市场利率水平上升时,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高债券组合收益率的目的。
2.期限结构策略
通过跟踪收益率曲线的形状和变化趋势,对各类债券进行久期配置;当收益率曲线走陡以至到期时,参考基准利率的样本券久期构建组合久期,确保组合收益率超过基准利率。具体来说,又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线形状的子弹策略、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期限利率曲线的一点,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布于收益率曲线,适用于收益率曲线水平移动。
3.类属配置策略
本基金将不同类属固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

4.信用债投资策略
信用债的投资等于基准利率加信用利差,信用利差收益主要受两个方面影响,一是该信用债对应信用等级下的市场平均信用利差曲线走势;二是该信用等级本身信用变化。基于这两方面的因素,我们分别采用以下的分析策略:
(1)基于信用利差曲线变化策略:一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响;二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响,最后综合各种因素,分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定信用债总体的及分行业投资比例。
(2)基于信用债信用变化策略:发生信用变化变化后,我们将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对信用债进行定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负负债和其他风险等五个方面。以确定企业主体信用的实际情况,从而进行投资。

5.息差对冲投资策略
本基金将在考虑债券资产的风险收益情况,以及融资成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过银行间市场融资,赚取一定的息差收益。
6.资产支持证券的投资策略
资产支持证券的价格受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的结构及质量、提前偿还率及其附加担保等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上,輔以信用、企业债等债券品种的相对价值比较,审慎投资资产支持证券类资产。

7.个券挖掘策略
本基金将强调通过个券挖掘的重要性,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。
九、基金的投资业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。
本基金选择上述业绩比较基准的原因:
中债综合全价(总值)指数是中央国债登记结算有限责任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,该指数按本行银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券、企业债、中期票据、短期融资券、公司债券等组成。根据本基金的投资范围和资产配置,选用上述业绩比较基准能客观合理地反映本基金投资组合特征。
若未来法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场发生变化导致本基金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,在与托管人协商一致并协商一致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,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金。

十一、基金投资组合报告
基金管理人就其董事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。
以下内容摘自本基金2019年第二季度报告:

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同的规定,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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
1.报告期末基金资产组合情况

		金额单位:人民币元	
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	2,703,298,100.00	98.28
	其中:债券	2,703,298,100.00	98.28
	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	--	--
	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	763,828.58	0.03
8	其他资产	46,570,329.02	1.69
9	合计	2,750,622,257.60	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
本基金本报告期末未持有境内股票。
(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

		金额单位:人民币元	
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债	2,509,178,100.00	110.90
	其中:政策性金融债	2,509,178,100.00	110.90
4	企业债	--	--
5	企业中期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(可交换债)	--	--
8	同业存单	194,120,000.00	8.68
9	其他	--	--
10	合计	2,703,298,100.00	119.48

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	160206	16国开06	2,700,000	269,514,000.00	11.91
2	130422	13农发22	2,000,000	205,020,000.00	9.06
3	190403	19农发03	1,300,000	129,857,000.00	5.74
4	190301	19国开01	1,300,000	129,792,000.00	5.74
5	150316	15国开16	1,100,000	110,660,000.00	4.89

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

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

组
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运用股指期货进行交易。
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运用国债期货进行交易。
11.投资组合报告附注
(1)报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
(2)本报告期末,本基金未投资股票,不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。
(3)其他资产构成

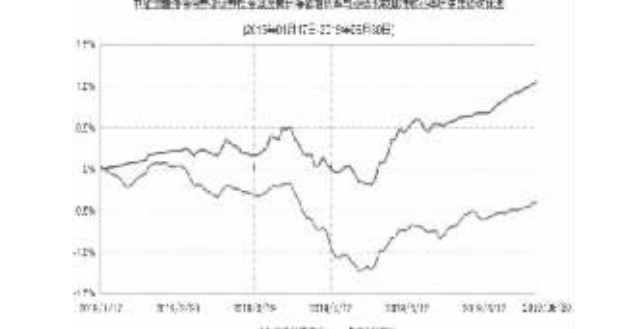
		金额(元)	
序号	名称		
1	存出保证金		2,234.86
2	应收证券清算款		--
3	应收股利		--
4	应收利息		46,568,094.16
5	应收申购款		--
6	其他应收款		--
7	其他		--
8	合计		46,570,329.02

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有流通受限股票。
(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十二、基金净值表现
1、自基金合同生效以来某基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	业绩增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2019年1月17日至2019年6月30日	1.06%	0.06%	-0.40%	0.05%	1.46%	0.01%

2、自基金合同生效以来某基金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



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事务所、律师费、诉讼费 and 仲裁费;
5.基金的证券交易费用及因基金投资产生的费用等;
6.基金的银行汇划费用;
7.基金开户开户费用、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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H= E× 0.30%÷当年天数
E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,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支付指令,基金托管人复核后于次月首日起第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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H= E× 0.10%÷当年天数
E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,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支付指令,基金托管人复核后于次月首日起第3个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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.基金管理人及基金托管人处理和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项纳税主体,其纳税义务按国家税法、法律法规执行。

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》、《证券投资基金信息披露办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,我公司结合中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金的运行情况,对其原招募说明书进行了更新,主要更新的内容说明如下:
(一)在“重要提示”部分更新了相关内容。
(二)更新了“一、基金费用的种类”的相关信息。
(三)更新了“四、基金托管人”的相关信息。
(四)更新了“六、基金的募集”的相关信息。
(五)更新了“七、基金合同的生效”的相关信息。
(六)更新了“八、基金份额的申购与赎回”的相关信息。
(七)在“九、基金的投资”中根据本基金的实际情况,更新了最近一期投资组合报告的内容,以及在“基金投资以来某基金业绩和同期业绩比较基准的表现”
(八)在“二十一、其他披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。
上述内容仅为摘要,须与本招募说明书(正文)所载之详细资料一并阅读。