信诚优质纯债债券型证券投资基金招募说明书摘要

（2014年第2次更新）

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中信银行股份有限公司

重要提示

本基金于2013年2月7日基金合同正式生效。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2014年8月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人：信诚基金管理有限公司

住所：　上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：　上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

设立日期：　2005年9月30日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142号

注册资本：　2亿元人民币

电话：　（021）6864 9788

联系人：　林军

股权结构：

股东	出资额（万元人民币）	出资比例（%）
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合计	20000	100

（二）主要人员情况

1.董事会成员

张翔燕女士，董事长，硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限责任公司风险管理部总经理。现任中信控股有限责任公司副总裁、兼任中信信诚资产管理有限公司（信诚基金管理有限公司之子公司）监事。

陈一松先生，董事，金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总裁办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书、中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任。现任中信信托有限责任公司总经理。

包学勤先生，董事，研究生。历任招商银行证券业务部出市代表、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、国信证券有限公司投资银行二部总经理、中信证券股份有限公司深圳投资银行部总经理、中信信托有限责任公司投资银行二部总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理。

Graham David Mason先生，董事，南非籍，保险精算专业学士。历任南非公募基金投资分析师、南非Norwich公司基金经理、英国保诚集团（南非）执行总裁。现任瀚亚投资执行副董事长。

黄慧敏女士，董事，新加坡籍，经济学学士。历任花旗银行消费金融事业部业务副理、新加坡大华银行业务开发副理、大华资产管理公司营销企划经理、瀚亚投资（新加坡）有限公司营销部主管、瀚亚投资（台湾）有限公司市场总监。现任瀚亚投资（台湾）有限公司总经理。

魏秀彬女士，董事，新加坡籍，工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司亚太地区风险及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官。

何德旭先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸所所长、研究员。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任。

夏执东先生，独立董事，经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华中兴会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所管委会副主席。

杨思群先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员，现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

注：原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务”自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资，其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

2.监事

李莹女士，监事会主席，金融学硕士。历任中国建设银行沧浪办事处信贷科长、中国建设银行苏州分行中间业务部总经理助理、北京证券投行华东部一级项目经理、中新苏州工业园区创业投资有限公司投资银行部总经理、苏州工业园区银杏投资管理有限公司副总经理。现任苏州元禾控股有限公司财务总监。

於乐女士，监事，经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行营业管理部主管、通用电气金融财务（中国）有限公司人力资源经理。 现任信诚基金管理有限公司首席人力资源官。

解晓然女士，监事，双学位，历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天冶基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

3.经营管理层人员情况

王俊锋先生，总经理，工商管理硕士。历任国泰基金管理有限公司市场部副总监、华宝兴业基金管理有限公司市场总监、瑞银环球资产管理(香港)有限公司北京代表处首席代表、瑞银证券有限责任公司资产管理部总监。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官，兼任中信信诚资产管理有限公司董事。

桂思毅先生，副总经理，工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员，中乔智威汤逊广告有限公司财务主管，德国德累斯登银行上海分行财务经理，信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官。

林军女士，副总经理，经济学硕士。历任浙江省证券公司投资银行部副总经理、市场总监，西南证券有限责任公司国际业务部总经理，招商基金管理有限公司总经理助理、营销总监，汇添富基金管理有限公司市场总监、副总经理，交银施罗德基金管理有限公司总经理助理、市场总监。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

隋晓炜先生，副总经理，经济学硕士，注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司市场总监、首席市场官、首席运营官。现任信诚基金管理公司副总经理、兼任中信信诚资产管理有限公司董事、总经理。

4.督察长

唐世春先生，督察长，法学硕士，历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书。现任信诚基金管理有限公司督察长，兼任中信信诚资产管理有限公司董事。

5.基金经理

王国强先生，管理学硕士。曾任职于浙江国际信托投资公司投行业务部、健桥证券股份有限公司债券业务部、银河基金管理有限公司机构理财部，长期从事固定收益证券分析和研究，精于固定收益证券及其衍生品定价、信用产品的风险分析等。2006年8月加盟信诚基金管理有限公司，担任固定收益分析师，现任信诚理财7日盈债券型证券投资基金、信诚添金分级债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金及信诚优质纯债债券型证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：李仆先生，2011年加盟信诚基金管理有限公司，自2013年2月至2014年2月，任信诚优质纯债债券型证券投资基金基金经理。

6.投资决策委员会成员

胡喆女士，副首席投资官、研究总监、特定资产投资管理总监；

王旭巍先生，副首席投资官；

董越先生，交易总监；

张光成先生，股票投资副总监；

王睿先生，研究副总监、投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

成立时间：1987年4月7日

组织形式：股份有限公司

注册资本：467.873亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：010-65558812

传真：010-65550832

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年，原名中信实业银行，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展，中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大，于2005年8月，正式更名“中信银行”。2006年12月，以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东，正式成立中信银行股份有限公司。同年，成功引进战略投资者，与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日，中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年，中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称：中信国金）70.32%股权。经过二十多年的发展，中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年，中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告，表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

（二）主要人员情况

李庆萍，行长，高级经济师。1984年8月至2007年1月，任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月，任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月，任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月，任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月，任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月，任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。

苏国新先生，中信银行副行长，分管托管业务。曾担任中信集团办公厅副主任、同时兼任中信集团董事长及中信银行董事长秘书。1997年6月开始担任中信集团董事长秘书。1991年8月至1993年10月，在中国外交部工作。1993年10至1997年5月在中信集团负责外事工作。1996年1月至1997年1月，在瑞士银行SBC和瑞士联合银行UBS等金融机构工作。

刘泽云先生，现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理，经济学博士。1996年8月进入本行工作，历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。

（三）基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2014年6月30日，中信银行已托管46只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，总托管规模逾3万亿元人民币。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.场外发售机构

（1）直销机构

名称：信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

电话：（021）6864 9788

联系人：杨雁

投资人可以通过基金管理人网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。网上交易网址：www.xcfunds.com

（2）代销机构

1）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

客服电话：95558

网址：http://bank.ecitic.com

2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

传真：010-66594946

电话：010-66594977

网址：www.boc.cn

3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：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号楼长安兴融中心

法定代表人：王洪章

电话：010－66275654

传真：010－66275654

联系人：张静

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

4）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755－83198888

传真：0755－83195049

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

5）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

6）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号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：顾凌

电话：0755-23835888、010-60838888

公司网站：www.cs.ecitic.com

7）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层

法定代表人：沈强

邮政编码：310052

公司网站：http://www.bigsun.com.cn

开放式基金咨询电话：0571-95548

服务邮箱：96598@bigsun.com.cn

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号青岛国际金融广场1号楼20层（266061）

办公地址：山东省青岛崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

9）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝内大街188号

法定代表人：王常青

统一客户服务电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

10）中国中投证券有限责任公司

注册地址：　深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18－21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人：龙增来

统一客户服务电话：400－600－8008、95532

公司网站：www.china-invs.cn

11）海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询

电话联系人：李芙鸣

网址：www.htsec.com

12）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

联系人：黄莹

联系电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523或者4008895523

网址：www.sywg.com.cn

13）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C　座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C　座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

联系电话：010-66568450

客户服务电话：4008－888－888

网站：www.chinastock.com.cn

14）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

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

客户服务热线：　4008888666

公司网址：　www.gtja.com

15）华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

16）西藏同信证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市永和路118弄24号

法定代表人：贾绍君

统一客户服务电话：4008811177

17）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号（200040）

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525、4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

18）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

19）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579或4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

20）天相投资顾问有限公司（简称“天相投顾”）

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：尹伶

联系电话：010-66045608

传真：010-66045521

天相投顾网址：http://www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

21）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：鹿馨方

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

22）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

全国统一总机：95511-8

联系人：郑舒丽(zhengshuli001@pingan.com.cn，0755-22626391)

网址：　www.pingan.com

23）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客服电话：95597

24）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40/42层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

网址：www.csco.com.cn

25）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人：其实

电　　话：021-54509998

传　　真：021-64385308

26）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

电　　话：021-58870011

传　　真：021-68596919

27）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电　　话：021-20691832

传　　真：021-20691861

28）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周嫣旻

电　　话：0571-28829790

传　　真：0571-26698533

29）深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

电　　话：0755-33227950

传　　真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

网址：　www.zlfund.cn及www.jmmw.com

30）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

31）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16层至26层

法人代表人：何如

联系电话：0755－82130833

基金业务联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

传真：0755－82133952

全国统一客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

32）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：（0755）82943666

传真：（0755）82943636

网址：www.newone.com.cn

客服电话：95565、4008888111

33）和讯信息科技有限公司、

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-20835787

传真：021-20835879

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

（二）注册登记机构

名称：信诚基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

联系电话：021－　68649788

传真：021-50120888

联系人：金芬泉

（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：韩炯

联系电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

办公地址：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法定代表人：姚建华

电话：8621　2212　2888

传真：8621　6288　1889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、黄小熠

四、基金的名称

信诚优质纯债债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上，本基金主要通过投资于精选的优质债券，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、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）。本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具，因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可上市交易后不超过20个交易日的时间内卖出。

本基金各类资产的投资比例范围为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。

2、固定收益类资产的投资策略

（1）类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

（2）普通债券投资策略

对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、流动性管理、相对价值配置等策略进行主动投资。

1）目标久期控制

本基金首先建立包含消费物价指数、固定资产投资、工业品价格指数、货币供应量等众多宏观经济变量的回归模型。通过回归分析建立宏观经济指标与不同种类债券收益率之间的数量关系，在此基础上结合当前市场状况，预测未来市场利率及不同期限债券收益率走势变化，确定目标久期。当预测未来市场利率将上升时，降低组合久期；当预测未来利率下降时，增加组合久期。

2）期限结构配置

在确定债券组合的久期之后，本基金将采用收益率曲线分析策略，自上而下进行期限结构配置。具体来说，本基金将通过对央行政策、经济增长率、通货膨胀率等众多因素的分析来预测收益率曲线形状的可能变化，从而通过子弹型、哑铃型、梯形等配置方法，确定在短、中、长期债券的投资比例。

3）信用利差策略

一般来说，信用债券的收益率主要由基准收益率与反应信用债券信用水平的信用利差组成。本基金将从宏观经济环境与信用债市场供需状况两个方面对市场信用利差进行分析。首先，对于宏观经济环境，当宏观经济向好时，企业盈利能力好，资金充裕，市场整体信用利差将可能收窄；当宏观经济恶化时，企业盈利能力差，资金紧缺，市场整体信用利差将可能扩大。其次，对于信用债市场供求，本基金将从市场容量、信用债结构及流动性等几方面进行分析。

4）相对价值投资策略

本基金将对市场上同类债券的收益率、久期、信用度、流动性等指标进行比较，寻找其他指标相同而某一指标相对更具有投资价值的债券，并进行投资。

5）回购放大策略

本基金将在控制杠杆风险的前提下，适当地通过回购融资来提高资金利用率，以增强组合收益。

3、资产支持证券的投资策略

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。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：中信标普全债指数收益率

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。

十一、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据基金合同的约定，于2014年7月16日复核了本招募说明书中的投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告的财务数据截止至2014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	－	－
	其中：股票	－	－
2	固定收益投资	1,468,377,505.05	95.77
	其中：债券	1,468,377,505.05	95.77
	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	－	－
	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	23,182,660.88	1.51
7	其他资产	41,678,750.46	2.72
8	合计	1,533,238,916.39	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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投资。

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	50,197,000.00	6.11
	其中：政策性金融债	50,197,000.00	6.11
4	企业债券	1,346,214,813.75	163.98
5	企业短期融资券	70,451,000.00	8.58
6	中期票据	－	－
7	可转债	1,514,691.30	0.18
8	其他	－	－
9	合计	1,468,377,505.05	178.86

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	124270	13渝万盛	500,000	50,000,000.00	6.09
2	124072	12曲公路	490,000	49,931,000.00	6.08
3	122744	11本溪债	436,170	45,710,616.00	5.57
4	122702	12海安债	435,560	45,232,906.00	5.51
5	122924	10巢湖债	405,480	41,764,440.00	5.09

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投资。

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

1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包括股指期货投资。

10. 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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

3）本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

11. 投资组合报告附注

1)本基金本期投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2)本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

3)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	66,569.31
2	应收证券清算款	5,187,151.77
3	应收股利	－
4	应收利息	36,422,529.38
5	应收申购款	2,500.00
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	41,678,750.46

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	110019	恒丰转债	849,980.50	0.10
2	110018	国电转债	124,188.40	0.02

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。

6)因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

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招募说明书。基金业绩数据截至2014年6月30日。

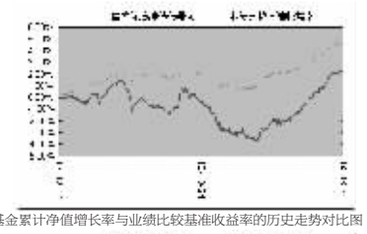
(一)A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2013年2月7日至2013年12月31日	-3.20%	0.16%	0.82%	0.05%	-4.02%	0.11%
2014年1月1日至2014年6月30日	5.79%	0.14%	3.87%	0.05%	1.92%	0.09%
2013年2月7日至2014年6月30日	2.40%	0.16%	4.76%	0.05%	-2.36%	0.11%

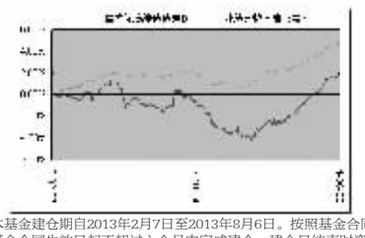
B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2013年2月7日至2013年12月31日	-3.60%	0.17%	0.82%	0.05%	-4.42%	0.12%
2014年1月1日至2014年6月30日	5.60%	0.15%	3.87%	0.05%	1.73%	0.10%
2013年2月7日至2014年6月30日	1.80%	0.16%	4.76%	0.05%	-2.96%	0.11%

(二)A级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



B级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



注：本基金建仓期自2013年2月7日至2013年8月6日。按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓，建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

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）基金财产划拨支付的银行费用；

4）基金合同生效后的基金信息披露费用；

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和律师费；

7）基金的证券交易费用；

8）本基金的B类基金份额从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

9）为基金财产及基金运作所开立帐户的开户费和维护费；

10）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

若本基金终止，清算时所发生的费用，按实际支出额从基金财产中扣除。

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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2）基金托管人的基金托管费

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3）B类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，B类基金份额的年销售服务费率为0.4%。

在通常情况下，B类基金份额销售服务费按前一日B类基金份额资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类基金份额前一日资产净值

B类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

4）除管理费、托管费、B类基金份额的销售服务费和前述十五（一）所列之外的基金费用，由基金托管人与基金管理人协商后，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。

3. 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。

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、B类基金份额的销售服务费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率或B类基金份额的销售服务费率等相关费率，须召开基金份额持有人大会；调低基金管理费率、基金托管费率或B类基金份额的销售服务费率等相关费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最