广发集裕债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
时间：二零一七年五月

【重要提示】

本基金于2016年3月30日经中国证监会证监许可 [2016]639号文准予募集注册。

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价值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。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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。

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，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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，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。

本基金可投资中小企业私募债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，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。本基金需承担债券市场的系统性风险，以及因个别债券违约所形成的信用风险，因此信用风险对基金份额净值影响较大。

本基金基金份额分为A、C类，A类基金份额收取认（申）购费，C类基金份额不收取认（申）购费，但计提销售服务费；A、C类基金份额适用不同的赎回费率。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书所载内容截止日为2017年5月11日，有关财务数据截止日为2017年3月31日，净值表现截止日为2016年12月31日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、概况

1、名称：广发基金管理有限公司
2、住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004－56室
3、办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31－33楼
4、法定代表人：孙树明
5、设立时间：2003年8月5日
6、电话：020－83936666
全国统一客服热线：95105828
7、联系人：段西军
8、注册资本：1.2688亿元人民币

9、股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135％、15.763％、15.763％、9.458％和7.881％的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

孙树明先生：董事长，博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中国注册会计师协会道德准则委员会委员，中国资产评估协会常务理事，上海证券交易所第三届理事会理事，上海证券交易所第一届上市咨询委员会委员，广东金融学会副会长，广东省预算腐败工作专家咨询委员会财政金融运行规范组成员，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。曾任财政部条法司副处长、处长，中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，中国银河证券有限公司监事会监事，中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传辉先生：副董事长，学士，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事长，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员、资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理。

孙晓燕女士：董事，硕士，现任广发证券执行董事、副总经理、财务总监，兼任广发控股（香港）有限公司董事，证通股份有限公司监事长。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、广发证券股份有限公司投资自营部副总经理，广发基金管理有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司财务部总经理。

戈俊先生：董事，硕士，高级会计师，现任烽火通信科技股份有限公司总裁，兼任南京烽火星空通信发展有限公司董事。曾任烽火通信科技股份有限公司财务部总经理助理、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

翟美卿女士：董事，硕士，现任深圳香江控股股份有限公司董事长，南方香江集团董事长、总经理，香江集团有限公司总裁、深圳市金海马实业股份有限公司董事长。兼任全国政协委员，全国妇联常委，中国女企业家协会副会长，广东省妇联副主席，广东省工商联副主席，广东省女企业家协会会长，香江社会救助基金会主席，深圳市深商控股集团股份有限公司董事，广东南粤银行董事，深圳龙岗国安村镇银行董事。曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人、董事。

许冬瑾女士：董事，硕士，副主任药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、常务副总经理，兼任世界中联中药饮片质量专业委员会副会长、国家中医药管理局对外交流合作专家咨询委员会委员、中国中药协会中药饮片专业委员会专家，全国中药标准化技术委员会委员， 全国制药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员， 国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工专业专家委员会副主任委员，广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。

罗海平先生：独立董事，博士，现任中华联合财产保险股份有限公司董事长、党委书记，兼任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理，保监会行业风险评估专家。曾任中国人民保险公司荆襄支公司经理、湖北省分公司国际保险部党组书记、总经理，汉口分公司党委书记、总经理，太平保险有限公司市场部总经理、湖北分公司党委书记、总经理、助理总经理、副总经理兼董事会秘书，阳光财产保险股份有限公司总裁，阳光保险集团执行委员会委员，中华联合财产保险股份有限公司总经理。

董茂云先生：独立董事，博士，高级经济师，现任宁波大学法学院教授、学术委员会主任，兼任绍兴银行独立董事，海尔施生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学教授、法律系副主任、法学院副院长。

姚海鑫先生：独立董事，博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学新华国际商学院教授、辽宁大学商学院博士生导师，兼任中国会计教授会理事、东北地区高校财务与会计教师联合会常务理事、辽宁省生产力学会副理事长、东北制药（集团）股份有限公司独立董事、沈阳化工股份有限公司独立董事和中兴－沈阳商业大厦（集团） 股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记、新华国际商学院副院长。

2、监事会成员

符兵先生：监事会主席，硕士，经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长，广东发展银行广州分行世贸支行行长、总行资金部处长，广发基金管理有限公司广州分公司总经理、市场拓展部副总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡丽军女士：监事，硕士，高级涉外秘书，现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任，广州屈臣氏公司行政主管，广州市科达实业发展公司办公室主任、总经理，广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉先生：监事，硕士，现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理，兼任广发基金分工会主席。曾任广发证券电脑中心副经理、经理。

张成柱先生：监事，学士，现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师，广发证券股份有限公司工程师，广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘敏女士：监事，硕士，现任广发基金管理有限公司产品营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理，营销服务部总经理助理，产品营销管理部总经理助理。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉先生：总经理，学士，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事长，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理。

朱平先生：副总经理，硕士，经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理，易方达基金管理有限公司投资部研究负责人，广发基金管理有限公司总经理助理，中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。

易阳方先生：副总经理，硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发聚丰混合型证券投资基金基金经理、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事，瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理、总经理助理，广发聚富开放式证券投资基金基金经理、广发制造业精选混合型证券投资基金基金经理。

段西军先生：督察长，博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证监会广东监管局工作。

邱春杨先生：副总经理，博士，瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员，广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、产品总监、金融工程部总经理。

魏恒江先生：副总经理，硕士，高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士：副总经理，硕士，兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国农业科学院助理研究员，中国证监会培训中心、监察局科员，基金监管部副处长及处长，私募基金监管部处长。

4、基金经理

张芊，女，中国籍，金融学硕士、MBA，16年证券业和基金业从业经历，持有中国证券投资基金业从业证书，2001年6月至2012年2月曾在中国银河证券研究中心、中国人保资产管理有限公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司从事固定收益类投研工作，2012年2月起任广发基金管理有限公司固定收益部总经理，2012年12月14日起任广发纯债债券基金的基金经理，2013年7月12日起任广发聚鑫债券基金的基金经理，2015年11月23日至2016年12月7日任广发聚盛混合基金的基金经理，2015年12月25日起任广发集鑫债券基金的基金经理，2015年12月29日任广发安富回报混合基金的基金经理，2015年12月30日至2017年2月5日任广发安宏回报混合基金的基金经理，2016年3月1日起任广发鑫裕混合基金的基金经理，2016年5月11日起任广发集裕债券基金的基金经理，2016年5月30日起任广发基金管理有限公司固定收益投资总监，2016年11月1日起任广发集丰债券基金的基金经理，2017年1月20日起任广发集安债券和广发集源债券基金的基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

主席：公司副总经理易阳方先生；成员：权益投资一部总经理李巍先生，研究发展部总经理孙迪先生，固定收益投资总监张芊女士。

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、基金托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
成立日期： 1988年8月22日
批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347号
组织形式：股份有限公司
注册资本：190.52336751亿元人民币
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【2005】74号
联系人：林成
联系电话：021－52629999－212012
传真：021－62159217

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5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本190.52亿元。

兴业银行主要经营范围包括：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；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理机构批准的其他业务。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“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，坚持走差异化发展道路，经营实力不断增强。截至 2016年12月31日，兴业银行资产总额达6.09万亿元，实现营业收入1570.60亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润538.50亿元。

在2015年英国《银行家》杂志全球银行1000强排名中，兴业银行按一级资本排名列第36位；在2015年《福布斯》全球上市企业2000强排名中，兴业银行位居第73位；在2015年《财富》世界500强中，兴业银行排名第271位，稳居全球银行50强、全球上市企业100强、世界企业500强。同时，在国内外各种权威机构组织的评比中，先后荣获“最佳中资银行”、“最佳战略创新银行”、“最佳绿色银行”、“亚洲可持续银行奖冠军”、“年度金控集团”、“最佳普惠金融银行”、“中国上市公司卓越董事会（主板）”、“亚洲最佳股东回报银行”、“最具社会责任上市公司”、“中华慈善突出贡献（单位）奖”、“中国最佳雇主”等多项大奖。

二、基金托管部门及主要人员情况

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、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处和养老金管理中心等处室，共有员工100余人， 业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、基金托管业务经营情况

截止2017年3月31日， 兴业银行已托管开放式基金173只， 托管基金财产规模5442.02亿元。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务：

（1）广州分公司
地址：广州市海珠区琶洲大道东1号南塔17楼
直销中心电话：020－89899073
传真：020－89899069　　020－89899070
（2）北京分公司
地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层
电话：010－68083368
传真：010－68083078
（3）上海分公司
地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路166号905－10室
电话：021－68885310
传真：021－68885200
（4）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：www.gffunds.com.cn
本司网址： www.gffunds.com.cn
客服电话：95105828（免长途费）或020－83936999
客服传真：020－34281105

（5）投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2、其他代销机构

本基金发售期间，若新增代销机构或代销机构新增营业网点，则另行公告。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

二、注册登记人

名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004－56室
法定代表人：孙树明
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31－33楼
电话：020－89898970
传真：020－89899175
联系人：李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市盈科（广州）律师事务所
住所：广东省广州市广州大道中289号南方传媒大厦15－18层
负责人：牟晋军
电话：020－66857288
传真：020－366857289
经办律师：刘智、陈琛
联系人：牟晋军

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表：卢伯卿
联系人：洪锐明
电话：021－61418888
传真：021－63350003
经办注册会计师：洪锐明、江丽雅

第四部分 基金的名称

广发集裕债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货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）。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、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）、大额存单、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，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：本基金投资于债券类资产比例不低于基金资产的80％，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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％。

第八部分 投资策略

（一）大类资产配置策略

本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。

（二）债券投资策略

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。

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、分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券等信用债券，以提高组合的收益水平。

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信用利差曲线配置、信用债供求分析策略、信用债券精选和信用债调整等四个方面。

4、可转债投资策略

可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

5、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析， 选择具有优势的品种进行投资， 并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要指资产抵押贷款支持证券（ABS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析， 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

7、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定， 结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

（三）股票投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资，以增加基金收益。

本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

投资方法上重视投资价值与成长潜力的平衡， 一方面利用价值投资标准筛选低价股票，避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险；另一方面，利用成长性投资可分享高成长收益的机会。

（四）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。

第九部分 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债总全价指数收益率。

中债总全价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、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体收益情况。

采用该比较基准主要基于如下考虑：

1、中债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；

2、在中债指数体系中，中债总全价指数所代表的债券市场的风险收益特征与本基金较为贴近。因此，中债总全价指数比较适合作为本基金的比较基准。

如果中央国债登记结算有限责任公司停止计算编制该指数或更改指数名称，经与基金托管人协商一致，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。

如果今后法律法规发生变化，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，基金管理人可以根据具体情况，依据维护基金份额持有人合法权益的原则， 经与基金托管人协商一致且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。

第十部分 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具有中低风险收益特征的品种。

第十一部分 投资组合报告

广发基金管理有限公司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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年5月15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至2017年3月31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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	52,175,820.80	18.59
	其中：股票	52,175,820.80	18.59
2	固定收益投资	223,094,221.30	79.50
	其中：债券	223,094,221.30	79.50
	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	1,026,221.47	0.37
7	其他各项资产	4,328,879.95	1.54
8	合计	280,625,143.52	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,091,000.00	0.78
C	制造业	26,015,294.28	9.67
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	3,384,513.52	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,990.00	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,989,523.00	6.31
J	金融业	3,691,500.00	1.37
K	房地产业	–	–
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	52,175,820.80	19.39

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	000333	美的集团	348,000	11,588,400.00	4.31
2	002268	卫士通	309,700	10,015,698.00	3.72
3	002450	康得新	469,994	8,986,285.28	3.34
4	300137	先河环保	300,000	4,635,000.00	1.72
5	000028	国药一致	44,959	3,384,513.52	1.26
6	600705	中航资本	500,000	3,075,000.00	1.14
7	300369	绿盟科技	100,000	2,810,000.00	1.04
8	600497	驰宏锌锗	300,000	2,091,000.00	0.78
9	002373	千方科技	100,000	1,314,000.00	0.49
10	300188	美亚柏科	64,000	1,219,200.00	0.45

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	19,983,000.00	7.43
	其中：政策性金融债	19,983,000.00	7.43
4	企业债券	41,648,000.00	15.48
5	企业短期融资券	89,844,000.00	33.39
6	中期票据	60,012,000.00	22.30
7	可转债（可交换债）	11,607,221.30	4.31
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	223,094,221.30	82.90

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	1480233	14昌平债	200,000	21,060,000.00	7.83
2	127161	15石国控	200,000	20,588,000.00	7.65
3	101552001	15中铝MTN001	200,000	20,100,000.00	7.47
4	101682009	16中铝业MTN002	200,000	20,038,000.00	7.45
5	011761006	17冀中能源SCP001	200,000	20,014,000.00	7.44

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

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1)根据公开市场信息，报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票未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	23,109.17
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,155,779.37
5	应收申购款	149,991.41
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,328,879.95

(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	113008	电气转债	9,201,316.30	3.42
2	110031	航信转债	913,905.00	0.34

(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。

第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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。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。基金业绩数据截至2016年12月31日。

一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发集裕债券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
自基金合同生效起至今	1.20%	0.19%	－1.11%	0.13%	2.31%	0.06%

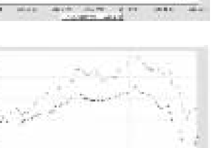
2、广发集裕债券C：

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
自基金合同生效起至今	0.90%	0.19%	－1.11%	0.13%	2.01%	0.06%

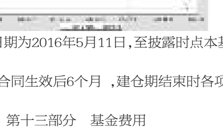
二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集裕债券型证券投资基金
自基金合同生效以来份额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
(2016年5月11日至2016年12月31日)

1、广发集裕债券A



2、广发集裕债券C



注：1、本基金合同生效日期为2016年5月11日，至披露时点本基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为基金合同生效后6个月 ，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

第十三部分 基金费用

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、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
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、律师费和诉讼费；
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、证券账户开户费用和银行账户维护费；
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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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0.50％年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50％÷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0.10％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。

3、销售服务费

本基金 A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.50％。在通常情况下，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.50％年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.50％÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金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前3个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

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、费用调整

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， 履行适当程序后，调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前在至少一种指定媒介上公告。

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》、《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，对原广发集裕债券型证券投资基金更新的招募说明书的内容进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“第三部分 基金管理人”部分，根据基金管理人的人员变动进行了更新。

2. 在“第四部分 基金托管人”部分，根据托管人基金托管业务经营情况对托管人信息进行了相应更新。

3. 在“第五部分 相关服务机构”部分，对原有销售机构的资料进行更新，变更了经办注册会计师的信息，相关事宜均已公告。

4. 在”第六部分 基金的募集”部分，对相关内容进行了精简与概括。

5. 在“第九部分 基金的投资”部分，更新了截至2017年3月31日的基金投资组合报告。

6. 在“第十部分 基金的业绩”部分，对截至2016年12月31日的基金业绩表现情况予以更新。

广发基金管理有限公司
二〇一七年五月二十六日

证券代码：002268　　证券简称：卫士通　　公告编号：2017－028

成都卫士通信息产业股份有限公司 2016年年度权益分派实施公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

成都卫士通信息产业股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）2016年年度权益分派方案已获2017年5月19日召开的公司2016年度股东大会审议通过，现将权益分派事宜公告如下：

一、权益分派方案

1、本公司2016年年度权益分派方案为：以公司现有总股本523，960，018股为基数，向全体股东每10股派0.500000元人民币现金（含税；扣税后，QFII、RQFII以及持有股改限售股、首发限售股的个人和证券投资基金每10股派0.450000元；持有非股改、非首发限售股及无限售流通股的个人股息红利税实行差别化税率征收，先按每10股派0.500000元，权益登记日后根据投资者减持股票情况，再按实际持股期限补缴税款；持有非股改、非首发限售股及无限售流通股的证券投资基金所涉红利税，对香港投资者持有基金份额部分按10％征收，对内地投资者持有基金份额部分实行差别化税率征收a；对于QFII、RQFII外的其他非居民企业，本公司未代扣代缴所得税，由纳税人在所得发生地缴纳。）；同时，以资本公积金向全体股东每10股转增6.00000股。

【a注：根据先进先出的原则，以投资者证券账户为单位计算持股期限，持股1个月（含1个月）以内，每10股补缴税款0.100000元；持股1个月以上至1年（含1年）的，每10股补缴税款0.050000元；持股超过1年的，不需补缴税款。】

分红前本公司总股本为523，960，018股，分红后总股本增至838，336，028股。

2、自本次权益分派方案披露至实施期间公司总股本未发生变化。本次实施的权益分派方案，与公司2016年度股东大会审议通过的议案一致。

3、本次实施权益分派方案距离股东大会审议通过的时间未超过两个月。

二、股权登记日与除权除息日

本次权益分派股权登记日为：2017年6月6日，除权除息日为：2017年6月7日。

三、权益分派对象

本次分派对象为：截止2017年6月6日下午深圳证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“中国结算深圳分公司”）登记在册的本公司全体股东。

四、权益分派方法

1、本次所送（转）股于2017年6月7日直接记入股东证券账户。在送（转）股过程中产生的不足1股的部分，按小数点后尾数由大到小排序依次向股东派发1股（若尾数相同时则在尾数相同者中由系统随机排序派发），直至实际送（转）股总数与本次送（转）股总数一致。

2、本公司此次委托中国结算深圳分公司代派的现金红利将于2017年6月7日通过股东托管证券公司（或其他托管机构）直接划入其资金账户。

3、以下A股股东的现金红利由本公司自行派发：

序号	股东账号	股东名称
1	08*****180	中国电子科技网络信息安全有限公司
2	08*****294	四川发展投资有限公司
3	08*****120	中电科投资控股有限公司
4	08*****173	四川省集成电路和信息安全产业投资基金有限公司

在权益分派业务申请期间（申请日：2017年5月22日至登记日：2017年6月6日），如因自派股东证券账户内股份减少而导致委托中国结算深圳分公司代派的现金红利不足的，一切法律责任与后果由我公司自行承担。

五、转增无限售流通股起始交易日

本次所送（转）的无限售流通股的起始交易日为2017年6月7日。

六、股份变动情况表

	本次变动前		本次变动增减（＋，－）	本次变动后	
	数量	比例（％）	公积金转股	数量	比例（％）
一、限售流通股（或非流通股）	179，327，715	34.23	107，596，629	286，924，344	34.23
1、首发后个人类限售股	6，451，612	1.23	3，870，967	10，322，579	1.23
2、高管锁定股	791，827	0.15	475，096	1，266，923	0.15
3、首发后机构类限售股	172，084，276	32.85	103，250，566	275，334，842	32.85
二、无限售条件股	344，632，303	65.77	206，779，381	551，411，684	65.77
三、股份总数	523，960，018	100	314，376，010	838，336，028	100.00

七、调整相关参数

本次实施转增股份后，按公司新股本838，336，028股摊薄计算，2016年度每股净收益为0.1858元。

八、咨询机构

咨询地址：四川省成都市高新区云华路333号卫士通大厦证券部
咨询联系人：舒梅、戚扬
咨询电话：028－62386169
传真电话：028－62386031

九、备查文件

1、中国结算深圳分公司确认有关分红派息、转增股本具体时间安排的文件；
2、公司第六届董事会第二十六次会议决议；
3、公司2016年度股东大会决议。

特此公告。

成都卫士通信息产业股份有限公司
董事会
2017年5月26日

股票代码：600595　　股票简称：中孚实业　　公告编号：临2017－069
债券代码：122093　　债券简称：11中孚债
债券代码：122162　　债券简称：12中孚债

河南中孚实业股份有限公司关于参加河南上市公司网上集体接待日暨投资者保护工作经验交流会的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

会议召开时间：2017年6月2日（星期五）14：00－17：00
会议召开地点：河南省郑州市逸泉国际大酒店三楼卢浮宫会议厅
会议召开方式：网络方式召开

河南中孚实业股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）已于2017年3月25日发布了2016年年度报告。根据河南上市公司协会下发的《关于举办河南上市公司网上集体接待日暨投资者保护工作经验交流会的通知》，为多渠道加强上市公司与投资者的沟通交流，便于广大投资者更深入全面的了解公司情况，本公司定于2017年6月2日参加河南上市公司网上集体接待日暨投资者保护工作经验交流会（以下简称“本次说明会”）。

一、说明会类型

本次说明会以网络方式召开，届时将就本公司2016年年度报告、公司治理、发展战略、经营状况、可持续发展等问题与投资者进行网上交流和沟通。

二、说明会召开的时间、地点

1.时间：2017年6月2日（星期五）14：00－17：00
2.地点：河南省郑州市逸泉国际大酒店三楼卢浮宫会议厅

三、参会人员

公司财务总监梅君女士、董事会秘书杨萍女士及证券事务代表丁彩霞女士。

四、投资者参加方式

投资者互动平台	http://rs.p5w.net
现场热线电话	0371－55565020

本公司欢迎投资者通过传真、电话、邮件等形式将需要了解的情况和关注问题提前提供给公司，公司将在说明会上就投资者普遍关注的问题进行回答。

五、会议议程

第一项：14：00主持人宣布会议开始并介绍嘉宾
第二项：14：05主办单位致辞
第三项：14：15深圳市全景网络有限公司领导致辞
第四项：14：25上市公司就投资者保护工作做经验分享
第五项： 14：45深圳市全景网络有限公司进行新媒体时代的投资者关系管理的相关培训
第六项：15：05网上交流开始，河南辖区上市公司分别回答投资者提问
第七项：17：00主持人宣布活动结束

六、联系人及咨询办法

1、联系人：杨萍女士、丁彩霞女士
2、电话：0371－64569088
3、传真：0371－64569089
4、邮箱：zhqb@zfsy.com.cn

特此公告。

河南中孚实业股份有限公司董事会
二〇一七年五月二十五日

股票代码：600595　　股票简称：中孚实业　　公告编号：临2017－071
债券代码：122093　　债券简称：11中孚债
债券代码：122162　　债券简称：12中孚债

河南中孚实业股份有限公司关于控股股东增持公司股份的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

今日，公司接控股股东河南豫联能源集团有限责任公司（以下简称“豫联集团”）通知，豫联集团于近两个交易日通过上海证券交易所交易系统增持了公司股份。现将有关情况公告如下：

一、本次增持情况

近两个交易日，公司控股股东豫联集团通过上海证券交易所交易系统以竞价买入方式增持本公司股份共计1，915，000股，增持金额约为8，602，782.27元人民币，占公司总股本的0.1100％。

本次增持前， 豫联集团持有公司股份数量为873，521，705股， 占公司总股本的50.158％；本次增持后，豫联集团持有公司股份总数为875，436，705股，约占公司股份总数的50.268％。

二、后续增持计划

2017年5月12日，公司在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露了《关于公司控股股东及部分董事、监事、高级管理人员拟增持公司股票的公告》（临2017－063号公告）：豫联集团及部分董事、监事、高级管理人员计划自2017年5月12日起6个月内，在公司股票价格低于5元/股时，通过上海证券交易所交易系统增持公司股份，豫联集团拟增持金额不低于人民币5，000万元；部分董事、监事、高级管理人员拟增持金额不低于人民币500万元。根据近来豫联集团及公司部分董事、监事、高级管理人员增持股份的合计情况，至今豫联集团增持金额累计达人民币33，596，951.61元，公司部分董事、监事、高级管理人员增持金额累计达人民币5，039，835.21元，详细情况见公司分别于2017年5月16日、2017年5月18日、2017年5月20日及2017年5月23日披露的临2017－064号公告、临2017－066号公告、临2017－067号公告及临2017－068号公告。本次豫联集团的增持为前述增持计划的具体实施，本次增持后，豫联集团还将持续关注公司股价走势及资本市场变化，并结合自身发展规划，在符合《上市公司收购管理办法》（2014年修订），《上海证券交易所股票上市规则》（2014年修订）等相关规定的情况下，适时执行上述增持计划。

三、本次增持符合《证券法》、《关于上市公司大股东及董事、监事、高级管理人员增持本公司股票相关事项的通知》等法律法规、部门规章及上海证券交易所的相关规定。

四、豫联集团及部分董事、监事、高级管理人员承诺，在增持实施期间及法定期限内不减持所持有的公司股份。

五、公司将根据《上市公司收购管理办法》（2014年修订）、《上海证券交易所股票上市规则》（2014年修订）、《上海证券交易所上市公司股东及其一致行动人增持股份行为指引》（2012年修订）等相关规定，持续关注豫联集团及部分董事、监事、高级管理人员所增持公司股份的有关情况，并及时履行信息披露义务。

特此公告。

河南中孚实业股份有限公司董事会
二〇一七年五月二十五日

股票代码：600595　　股票简称：中孚实业　　公告编号：临2017－070
债券代码：122093　　债券简称：11中孚债
债券代码：122162　　债券简称：12中孚债

河南中孚实业股份有限公司关于“11中孚债”及“12中孚债”公司债券恢复债券质押式回购的提示性公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

2017年5月15日，信用评级机构联合信用评级有限公司在对本公司经营状况及行业情况进行综合分析与评估的基础上，出具了《河南中孚实业股份有限公司公司债券2017年跟踪评级报告》，本次公司主体长期信用评级结果为：AA，评级展望为“稳定”；河南中孚实业股份有限公司2011年公司债券（债券简称“11中孚债”， 债券代码：122093 ）、河南中孚实业股份有限公司2012年公司债券（债券简称“12中孚债”， 债券代码：122162）评级结果为：AA。详见公司于2017年5月17日披露的临2017－065号公告及同时在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《河南中孚实业股份有限公司公司债券2017年跟踪评级报告》。

根据《上海证券交易所公司债券上市规则》及《质押式回购资格准入标准及标准券折扣系数取值业务指引》的有关规定，公司发行的“11中孚债”、“12中孚债”已符合上海证券交易所债券质押式回购交易的条件。自2017年5月31日起，上海证券交易所将“11中孚债”、“12中孚债”作为回购质押券纳入质押库，并恢复债券质押式回购入库申报。“11中孚债”、“12中孚债”质押券申报和转回的代码分别为“104093”、“104162”，出入库简称分别为“11中孚质”、“12中孚质”。

特此公告。

河南中孚实业股份有限公司董事会
二〇一七年五月二十五日