汇添富长添利定期开放债券基金更新招募说明书摘要

（2017年第1号）

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

重要提示

本基金经 2014年11月6日中国证券监督管理委员会证监许可【2014】1171号文准予募集注册,并于2016 年10 月9 日获得中国证监会证券基金机构监管部《关于汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函[2016]2412号)。本基金基金合同于2016年12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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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及《基金合同》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,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。

中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种,其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种,会影响组合的风险特征。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易,由于不公开资料,外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级,可能会降低市场对该类债券的认可度,从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大,同时,各类材料(包括募集说明书、审计报告)不公开发布,也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

本基金是债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种,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。投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书更新截止日为2017年6月6日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31日,有关基金管理人的内容截至招书公告日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

第一部分、基金管理人

(一)基金管理人简况

名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼22楼
法定代表人:李文
成立时间:2005年2月3日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:证监基金字[2005]5号
注册资本:人民币132,724,224元
联系人:李鹏
联系电话:021–28932888
股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

李文先生,2015年4月16日担任董事长。国籍:中国,1967 年出生,厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长,中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长,中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长,东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理,稽核总部总经理,东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理,汇添富基金管理股份有限公司督察长。

肖顺喜先生,2004年4月20日担任董事。国籍:中国,1963年出生,复旦大学EMBA。现任东航金控有限责任公司董事长兼党委书记,东航集团财务有限责任公司董事长,东航期货有限责任公司董事长,东航国际控股(香港)有限公司董事长,东航国际金融(香港)有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理,东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

程峰先生,2016年11月20日担任董事。国籍:中国,1971 年出生,上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理,上海上报资产管理有限公司董事长,上海文化产权交易所股份有限公司董事长,上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记,上海机械进出口(集团)有限公司副总裁,上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长,上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长,上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任,上海国际集团有限公司行政管理总部总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长,上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

张晖先生,2015年4月16日担任董事,总经理。国籍:中国,1971年出生,上海财经大学数量经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理,汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师,富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理,汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资总监、投资决策委员会副主席,曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

韦杰夫(Jeffrey R. Williams)先生,2007年3月2日担任独立董事。国籍:美国,1953年出生,哈佛大学商学院工商管理硕士,哈佛大学肯尼迪政府学院艾什民主治理与创新中心高级研究学者。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长,美国运通银行台湾分行副总裁,台湾美国运通国际股份有限公司副总裁,渣打银行台湾分行总裁,深圳发展银行行长,哈佛上海中心董事总经理。

林志军先生,2015年4月16日担任独立董事。国籍:中国香港,1955年出生,厦门大学经济学博士,加拿大Saskatchewan大学工商管理学硕士。现任澳门科技大学商学院院长、教授、博导,历任福建省科学技术委员会计划财务处会计。五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员,厦门大学会计师事务所副主任会计师,厦门大学经济学院讲师、副教授,伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者,美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者,加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured),香港大学商学院访问教授,香港浸会大学商学院会计与法律系教授,博导,系主任。

杨燕青女士,2011年12月19日担任独立董事,国籍:中国,1971年出生,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,第一财经研究院院长,中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员,《第一财经日报》创刊编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创始人和主持人,《波士堂》栏目资深评论员。曾任《解放日报》主任记者,《第一财经日报》编委,2002–2003年期间受邀成为约翰–霍普金斯大学访问学者。

2、监事会成员

任瑞良先生,2004年10月20日担任监事,2015年6月30日担任监事会主席。国籍:中国,1963年出生,大学学历,会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生,2015年9月8日担任监事。国籍:中国,1973年出生,硕士研究生,注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员,金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任(主持工作),东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东,2015年4月16日担任监事,国籍:中国,1978年出生,国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司,东航集团财务有限责任公司。

王静女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,1977年出生,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金控有限责任公司发展部。

林旋女士,2008年2月23日担任职工监事,国籍:中国,1977年出生,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监,汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生,2013年8月8日担任职工监事,国籍:中国,1979年出生,北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司,泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)

张晖先生,2015年6月25日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

雷继明先生,2012年3月7日担任副总经理。国籍:中国,1971年出生,工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理,中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

娄焱女士,2013年1月7日担任副总经理。国籍:中国,1971年出生,金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

袁建军先生,2015年8月5日担任副总经理。国籍:中国,1972年出生,金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理,汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理,并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生,2017年3月3日担任副总经理。国籍:中国,1969出生,武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长,厦门建行信用卡部副处长、处长,厦门建行信息技术部处长,建总行北京开发中心负责人,建总行信息技术管理部副总经理,建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生,2015年6月25日担任督察长。国籍:中国,1978年出生,上海财经大学经济学博士,历任上海证监局主任科员、副处长,上海农商银行同业金融部副总经理,汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

曾刚先生,国籍:中国,1971年出生,中国科技大学学士,清华大学MBA,16年证券从业经历。曾在红塔证券自营业务总部、汉唐证券债券业务总部、华宝兴业基金研究部负责宏观经济和债券的研究,曾任上海电气财务公司资产管理部经理助理,2008年5月15日至2010年2月5日任华富基金管理有限公司华富货币基金的基金经理,2008年5月28日至2011年11月1日任华富收益增强债券基金的基金经理,2010年9月8日至2011年11月1日任华富强化回报债券基金的基金经理。2011年11月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部高级经理,现任固定收益投资副总监。2012年5月9日至2014年1月21日任汇添富理财30天基金的基金经理,2012年6月12日至2014年1月21日任汇添富理财60天基金的基金经理,2012年9月18日至今任汇添富多元收益基金的基金经理,2012年10月18日至2014年9月17日任汇添富理财28天基金的基金经理,2013年1月24日至2015年3月31日任汇添富理财21天基金的基金经理,2013年2月7日至今任汇添富可转换债券基金的基金经理,2013年5月29日至2015年3月31日任汇添富理财7天基金的基金经理,2013年6月14日至今任汇添富实业债基金的基金经理,2013年9月12至2015年3月31日任汇添富现金宝货币基金的基金经理,2013年12月3日至今任汇添富双利增强债券基金的基金经理,2015年11月26日至今任汇添富安鑫智选混合基金的基金经理,2016年2月17日至今任汇添富6月红定期开放债券基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理,2016年4月19日至今任汇添富盈安保本混合基金的基金经理,2016年8月3日至今任汇添富盈稳保本混合基金的基金经理,2017年5月15日至今任添富年年益定开混合的基金经理。

李怀定先生,国籍:中国,复旦大学经济学博士,10年证券从业经验。曾任华泰证券股份有限公司固定收益部员工,光大证券股份有限公司研究所债券分析师,国信证券股份有限公司经济研究所固定收益高级分析师。2012年5月加入汇添富基金管理股份有限公司任固定收益高级分析师。2015年5月25日至今任汇添富增强收益债券基金的基金经理助理,2015年11月18日至今任汇添富季季红定期开放债券基金、汇添富纯债(LOF)基金(原汇添富互利分级债券基金)的基金经理,2015年12月2日至今任汇添富达欣混合基金的基金经理,2016年3月11日至今任汇添富盈鑫保本混合基金的基金经理,2016年3月16日至今任汇添富稳健添利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月6日至今任汇添富长添利定期开放债券基金的基金经理,2016年12月21日至今任汇添富新睿精选混合基金的基金经理,2016年12月26日至今任汇添富鑫瑞债券基金的基金经理,2017年4月14日至今任添富年年泰定开混合的基金经理。

5、投资决策委员会

主席:袁建军(副总经理)

成员:韩贤旺先生(首席经济学家)、王栩(权益投资总监)、陆文磊(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究副总监)

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分、基金托管人

1、基本情况

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
成立时间:1996年2月7日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号
组织形式:其他股份有限公司(上市)
注册资本:28,365,585,227元人民币
存续期间:持续经营
电话:010–58560666
联系人:罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康的发展势头。

2000年12月19日,中国民生银行A股股票(600016)在上海证券交易所挂牌上市。 2003年3月18日,中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券,成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009年11月26日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来,按照"团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守法;讲究质量,提高效益,健康发展"的经营发展方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了"大集中"科技平台、"两率"考核机制、"三卡"工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新,实现了低风险、快增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2010年2月3日,在"卓越2009年度金融理财排行榜"评选活动中,中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评,荣获卓越2009年度金融理财排行榜"十佳电子银行"奖。

2010年10月,在经济观察报主办的"2009年度中国最佳银行评选"中,民生银行获得评委会奖——"中国银行业十年改革创新奖"。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓著的银行而特别设立的。

2011年12月,在由中国金融认证中心(CFCA)联合近40家成员行共同举办的2011中国电子银行年会上,民生银行荣获"2011年中国网上银行最佳网银安全奖"。这是继2009年、2010年荣获"中国网上银行最佳网银安全奖"后,民生银行第三次获此殊荣,是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯定。

2012年6月20日,在国际经济高峰论坛上,民生银行贸易金融业务以其2011–2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获"2012年中国卓越贸易金融银行"奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》"中国银行业成就奖—最佳贸易金融银行奖"之后第三次获此殊荣。

2012年11月29日,民生银行在《The Asset》杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中获得"中国最佳银行–新秀奖"。

2013年度,民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构"最佳资金托管银行"及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届"21世纪亚洲金融年会"上,民生银行荣获"2013?亚洲最佳投资金融服务银行"大奖。

在"2013第五届卓越竞争力金融机构评选"中,民生银行荣获"2013卓越竞争力品牌建设银行"奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书(2013)》中,民生银行荣获"中国企业上市公司社会责任指数第一名"、"中国民营企业社会责任指数第一名"、"中国银行业社会责任指数第一名"。

在2013年第十届中国最佳企业公民评选中,民生银行荣获"2013年度中国最佳企业公民大奖"。

2013年还获得年度品牌金博奖"品牌贡献奖"。

2014年获评中国银行业协会"最佳民生金融奖"、"年度公益慈善优秀项目奖"。

2014年荣获《亚洲企业管治》"第四届最佳投资者关系公司"大奖和"2014亚洲企业管治典范奖"。

2014年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予"亚洲贸易金融创新服务"称号。

2014年还荣获《亚洲银行家》"中国最佳中小企业贸易金融银行奖",获得《21世纪经济报道》颁发的"最佳资产管理私人银行"奖,获评《经济观察》报"年度卓越私人银行"等。

2015年度,民生银行在《金融理财》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中荣获"金牌创新力托管银行奖"。

2015年度,民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度"中国最佳实物黄金投资银行"称号。

2015年度,民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书(2015)》"中国银行业社会责任发展指数第一名"。

2015年度,民生银行在《经济观察报》主办的2014–2015年度中国卓越金融奖评选中荣获"年度卓越创新战略创新银行"和"年度卓越直销银行"两项大奖。

2、主要人员情况

杨春萍:女,北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行,意大利联合信贷银行北京代表处,中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理,意大利联合信贷银行北京代表处代表,中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有近三十年的金融从业经历,丰富的外资银行工作经验,具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工68人,平均年龄36岁,100%员工拥有大学本科以上学历,80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向,秉承"诚信、严谨、高效、务实"的经营理念,依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台,为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至2017年3月31日,中国民生银行已托管164只证券投资基金,托管的证券投资基金总净值达到5007.92亿元。中国民生银行于2007年推出"托付民生·安享财富"托管业务品牌,塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象,赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评,深化了与客户的战略合作。自2010年至今,中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的"最具潜力托管银行"、"最佳创新托管银行"和"金牌创新力托管银行"奖,荣获《21世纪经济报道》颁发的"最佳金融服务托管银行"奖。

第三部分、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

(1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932893
传真:(021)50199035
联系人:陈卓膺
客户服务电话:400–888–9918(免长途话费)
网址:www.99fund.com

(2)汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统(trade.99fund.com)

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售基金,并及时公告。

(二)登记机构
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932888
传真:(021)28932998
联系人:韩从慧

(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
经办律师:黎明、孙睿
联系人:陈颖华

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
首席合伙人:吴港平
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
邮政编码:100738
公司电话:(010)58153000
公司传真:(010)85188298
签章会计师:陈露、陈军
业务联系人:陈露、陈军

第四部分、基金的名称

本基金名称:汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金。

第五部分、基金的类型

本基金为契约型开放式债券型证券投资基金。

第六部分、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,力求在本金安全的基础上实现资产的长期稳健增值。

第七部分、基金的投资方向

本基金的投资范围为固定收益类金融工具,包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款及协议存款)等,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)。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证,也不参与一级市场新股申购。因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。

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。

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,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期持有的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%。

第八部分、基金的投资策略

在每一运作周期内,本基金将投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金当期运作周期剩余期限的固定收益类金融工具,并主要采取买入并持有的策略,辅以回购融资策略,以力争获得超过业绩比较基准的收益率。

1、类属资产配置策略

不同类属的券种,由于受到不同的因素影响,在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各券种的利差变化趋势,综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素,合理配置并动态调整不同类属债券的投资比例。

2、普通债券投资策略

(1)利率策略

本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构,结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判,从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上,结合期限利差与凸度综合分析,制定出具体的利率策略。

具体而言,本基金将首先采用"自上而下"的研究方法,综合研究主要经济变量指标,分析宏观经济情况,建立经济前景的场景模拟,进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势与结构,对影响资金面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模拟。

在此基础上,本基金将结合历史与经验数据,区分当前利率收益率曲线的期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,判断收益率曲线参数变动的程度与概率,即对收益率曲线平移的方向,陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析,以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现向正平移的概率较大时,即市场利率将上升,本基金将降低组合久期以规避损失;如出现负向平移的概率较大时,则提高组合久期;如收益率曲线将趋于陡峭时,则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上,利用蝶形策略获取超额收益。

(2)信用策略

信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率加上反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济政策环境的影响,信用利差收益率主要受对应信用债券的信用等级和信用债券本身的信用变化的影响,因此本基金分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略。

1)基于信用利差曲线变化的策略

本基金将以下两方面分析信用利差的变化情况,并采取相应的投资策略:

宏观经济环境对信用利差的影响:当宏观经济向好时,信用利差可能由于发债主体盈利能力改善而收窄;反之,信用利差可能扩大。本基金将根据宏观经济的变化情况,加大对信用利差收窄的债券的投资比例。

市场供求关系对信用利差的影响:信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给,而政策的变化、其他类属资产的收益率变化等也将影响投资者对信用债券的需求,从而对信用利差产生影响。本基金将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素,在具有不同信用利差的品种间进行动态配置。

2)基于本身信用变化的策略

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。

为了准确评估发债主体的信用风险,基金管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从"行业风险"–"公司风险"(包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况、及企业财务状况)–"外部支持"(外部政府性支持能力、及债券担保情况)–"得到评分"的评级过程。其中,定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析,主要包括四个方面:盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究,定性分析是对定量分析的重要补充,能够有效提高定量分析的准确性。

本基金内部的信用评级体系定位为即期评级,侧重于评级的准确性,从而为信用产品的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪,发掘相对价值被低估的债券,以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。

(3)个券选择策略

本基金将根据信用债券市场的收益率水平,在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上,建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型,并通过这些模型进行估值,重点选择具备以下特征的信用债券:较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善,以及价值尚未被市场充分发现的个券。

3、可转换债券投资策略

对于本基金中可转换债券的投资,本基金主要采用可转换债券相对价值分析策略。

由于可转换债券兼具债权和股权,其投资风险和收益介于股票和债券之间,可转换债券相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转换债券的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。

其次,在进行可转换债券筛选时,本基金还对可转换债券自身的基本面要素进行综合分析,这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金将可转换债券自身的基本面分析和其基础股票的基本面分析结合在一起,最终确定投资的品种。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行分类,以便准确评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好的中小企业私募债券进行投资。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

5、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

在资产支持证券的选择上,本基金将采取自上而下和自下而上相结合的策略。自上而下投资策略指在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,本基金运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素进行分析,对收益率走势及其收益和风险进行判断;自下而上投资策略指运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

6、回购融资策略

本基金将根据市场资金面和债券市场基本面情况,积极参与债券回购交易,在回购利率运行较为平稳时期,进行适当的回购融资;将信用产品投资和回购交易结合起来,可以获得较为稳健的收益。本组合将根据信用产品的特征,在信用风险和流动性风险可控的前提下,通过回购融资来获取超额收益,或通过回购的不断滚动来获取信用债收益率和资金成本的利差。回购融资套利的投资券种以流动性好的券种为主,债券剩余期限(或回售期限)不超过基金当期运作周期剩余期限。

7、再投资策略

在运作周期内,本基金持有的债券将获得一些利息收入,对于这些利息收入,本基金将根据不同类属券种的基本面状况、市场交易情况等因素,再投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金当期运作周期剩余期限的固定收益类品种。

(四)基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

1、投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
(2)国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响;
(3)国家货币政策及债券市场政策;
(4)商业银行的信贷扩张;
(5)债券市场的基本情况。

2、投资决策程序

(1)宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断利率的走向,提交策略报告。
(2)债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告。
(3)信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。
(4)数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。
(5)在分析研究报告的基础上,基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。
(6)投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。
(7)如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。
(8)集中交易室执行交易指令。

(五)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)在运作周期内,本基金投资的金融工具的到期日应不晚于运作周期的最后一日;
(2)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;
(3)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,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制;
(4)本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
(5)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(6)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(7)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(13)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;
(14)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;本基金投资中小企业私募债券的剩余期限不得超过一运作周期的剩余期限;
(15)封闭期内,本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的200%;开放期内,本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
(16)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得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)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会、基金合同另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(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。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

若法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,如适用于本基金,则基金管理人在履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制或以变更后的规定为准。

第九部分、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:银行五年期定期存款税后利率。

如果今后法律法规发生变化,或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,或者市场中出现其他代表性更强、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。

第十部分、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预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。

第十一部分、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

投资组合报告

1.1 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	14,791,438,944.91	97.48
	其中:债券	14,791,438,944.91	97.48
	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	65,000,000.00	0.43
	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	65,054,893.52	0.43
8	其他资产	253,004,987.49	1.67
9	合计	15,174,498,825.92	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
1.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。
1.3 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
注:本基金本报告期末未持有股票。
1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	1,520,749,629.88	10.04
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	4,991,501,881.00	32.95
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	7,143,779,948.57	47.16
7	可转债(可交换债)	11,998,000.00	0.08
8	同业存单	412,139,485.46	2.72
9	其他	711,270,000.00	4.70
10	合计	14,791,438,944.91	97.64

注:1、根据基金合同规定,本基金除具有可转换债券外的固定收益类金融工具以摊余成本进行后续计量;可转债(可交换债)根据公允价值进行后续计量。

2、"其他"包含以公允价值计量的企业债券(408,840,000.00元)以及以公允价值计量的中期票据(302,430,000.00元)。

3、由于四舍五入的原因各比例分项之和与合计可能有尾差。

1.5 报告期末按摊余成本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	101551020	15中油股MTN001	13,000,000	1,302,730,983.81	8.60
2	122723	12石油05	12,300,000	1,285,499,329.83	8.49
3	124153	13国网01	10,000,000	1,030,652,183.13	6.80
4	1382312	13中铁建MTN1	10,000,000	1,029,101,746.58	6.79
5	091402002	14中国华融债02	10,000,000	1,008,433,819.34	6.66

1.6 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
1.7 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。
1.8 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末本基金无国债期货持仓。
1.10 投资组合报告附注
1.10.1
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
1.10.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	165,023.34
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	252,839,964.15
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	253,004,987.49

1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。
1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。

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、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。

(一)本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

长添利A

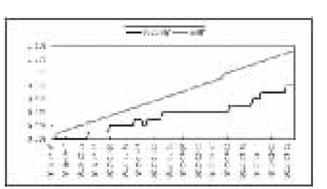
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)–(3)	(2)–(4)
2016年12月6日(基金合同生效日)至2016年12月31日	0.20%	0.03%	0.19%	0.00%	0.01%	0.03%
2017年1月1日(基金合同生效日)至2017年3月31日	0.80%	0.03%	0.68%	0.00%	0.12%	0.03%
2016年12月6日(基金合同生效日)至2017年3月31日	1.00%	0.03%	0.87%	0.00%	0.13%	0.03%

长添利C

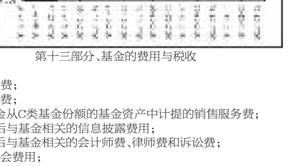
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)–(3)	(2)–(4)
2016年12月6日(基金合同生效日)至2016年12月31日	0.10%	0.02%	0.20%	0.00%	–0.10%	0.02%
2017年1月1日(基金合同生效日)至2017年3月31日	0.70%	0.03%	0.68%	0.00%	0.02%	0.03%
2016年12月6日(基金合同生效日)至2017年3月31日	0.80%	0.03%	0.87%	0.00%	–0.07%	0.03%

(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图

长添利A



长添利C



第十三部分、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、销售服务费:本基金从C类基金份额的基金资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/期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的开户费用、账户维护费用;
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。

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
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,经基金托管人复核后于次月首日起2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,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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
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首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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0.40%。

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。

计算方法如下:

H=E×0.40%÷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

销售服务费每日计算,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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由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,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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、基金税收

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。

五、与基金销售有关的费用

1、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章"基金的申购与赎回"相应内容。

2、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章"基金的申购与赎回"相应内容。

第十四部分、对招募说明书更新部分的说明

一、"重要提示"部分:
增加了基金合同的生效日、招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。
二、"三、基金管理人"部分:
更新了基金管理人的相关信息。
三、"四、基金托管人"部分:
更新了基金托管人的相关信息。
四、"五、相关服务机构"部分:
更新了相关服务机构的相关信息。
五、"六、基金的募集"部分:
增加了基金募集的情况。
六、"七、基金合同的生效"部分:
增加了基金合同的生效日。
七、"八、基金份额的申购和赎回"部分
调整了受限期业务规则,同时更新了基金申购单笔金额下限及最低赎回、保留份额。
八、"十一、基金的投资"部分:
增加了基金投资组合报告。
九、"十二、基金的业绩"部分:
增加了基金业绩表现数据。
十、"十四、基金的费用与税收"部分:
调整了基金管理人的管理费计提标准。
十一、"二十四、其他应披露事项"部分:
增加了2016年12月7日至2017年6月6日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司
2017年7月15日

证券代码:002775　　证券简称:文科园林　　公告编号:2017–045

深圳文科园林股份有限公司第二届董事会第二十九次会议决议公告

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

一、董事会会议召开情况

深圳文科园林股份有限公司(以下简称"公司")第二届董事会第二十九次会议通知于2017年7月7日以电话、邮件形式发出,会议于2017年7月14日以现场和通讯表决结合的方式在公司会议室召开。会议应出席的董事9人,实际出席的董事9人,会议由董事长李从文主持。本次会议的召开符合《中华人民共和国公司法》及相关法律、法规以及《深圳文科园林股份有限公司章程》的规定。

二、董事会会议审议情况

(一)审议通过了《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的议案》

根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,夏树林、曹莉因个人原因离职而失去激励资格,公司将回购注销上述2名激励对象已授予但尚未解锁的限制性股票共20,000股。《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的公告》详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

表决结果:赞成票9票,反对票0票,弃权票0票。

公司监事会对此议案发表了核查意见,公司独立董事对此议案发表了独立意见。独立董事意见及北京国枫律师事务所就此事出具的法律意见书详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

(二)审议通过了《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的议案》

根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,截至目前,公司限制性股票激励计划第一个解锁期解锁条件已达成,公司将对满足条件的限制性股票申请解除锁定。《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的公告》详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

李从文先生、田守能先生、高育慧先生、赵文凤女士作为《限制性股票激励计划》的激励对象,为关联董事,上述关联董事在审议该议案时已回避表决。

表决结果:赞成票5票,反对票0票,弃权票0票。

公司监事会对此议案发表了核查意见,公司独立董事对此议案发表了独立意见。独立董事意见及北京国枫律师事务所就此事出具的法律意见书详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

三、备查文件

1.第二届董事会第二十九次会议决议
2.独立董事对第二届董事会第二十九次会议相关事项的独立意见
3.北京国枫律师事务所关于深圳文科园林股份有限公司2016年限制性股票激励计划之限制性股票第一次解锁及回购注销部分限制性股票相关事项的法律意见书

特此公告

深圳文科园林股份有限公司董事会
二〇一七年七月十四日

证券代码:002775　　证券简称:文科园林　　公告编号:2017–046

深圳文科园林股份有限公司第二届监事会第十八次会议决议公告

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

一、监事会会议召开情况

深圳文科园林股份有限公司(以下简称"公司")第二届监事会第十八次会议通知于2017年7月7日以电话、邮件形式发出,会议于2017年7月14日以现场及通讯方式在公司会议室召开。会议应出席的监事3人,实际出席的监事3人,会议由监事会主席鄢春梅女士主持。本次会议的召开符合《中华人民共和国公司法》及相关法律、法规以及《深圳文科园林股份有限公司章程》的规定。

二、监事会会议审议情况

(一)审议通过了《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的议案》

根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,夏树林、曹莉因个人原因离职而失去激励资格,公司将回购注销上述2名激励对象已授予但尚未解锁的限制性股票共20,000股。《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的公告》详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

表决结果:3票同意,0票反对,0票弃权。

经公司全体监事审议,一致认为:公司原激励对象夏树林、曹莉因离职已不符合激励条件。根据公司《限制性股票激励计划》的规定,公司将回购注销其已获授但尚未解锁的限制性股票共20,000 股,回购价格为9.34元/股。公司本次回购注销已离职股权激励对象所持已获授但尚未解锁的限制性股票的程序符合相关规定,同意公司回购注销其已获授但尚未解锁的限制性股票。

(二)审议通过了《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的议案》

根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,截至目前,公司限制性股票激励计划第一个解锁期解锁条件已达成,公司将对满足条件的限制性股票申请解除锁定。《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的公告》详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

由于公司《限制性股票激励计划》的激励对象修永华先生与监事鄢春梅女士为夫妻关系,关联监事鄢春梅女士在审议该议案时回避表决。

表决结果:赞成票2票,反对票0票,弃权票0票。

监事会对激励对象名单进行核查后认为,公司210名激励对象解锁资格合法有效,满足《限制性股票激励计划》对授予的限制性股票设定的第一个解锁期解锁条件,并同意公司按照相关规定为激励对象办理第一期解锁手续。

三、备查文件

1.第二届监事会第十八次会议决议

特此公告

深圳文科园林股份有限公司监事会
二〇一七年七月十四日

证券代码:002775　　证券简称:文科园林　　公告编号:2017–047

深圳文科园林股份有限公司关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的公告

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

深圳文科园林股份有限公司(以下简称"公司")于2017年7月14日召开了公司第二届董事会第二十九次会议,审议通过了《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的议案》,同意回购注销原激励对象夏树林已获授但尚未解锁的 10,000 股限制性股票,同意回购注销原激励对象曹莉已获授但尚未解锁的 10,000 股限制性股票。根据公司 2016 年第一次临时股东大会的授权,公司董事会将依法办理限制性股票的回购注销手续并及时履行信息披露义务。现将有关事项说明如下:

一、公司限制性股票激励计划简述

1.2016年3月22日, 公司分别召开第二届董事会第十七次会议和第二届监事会第八次会议,审议通过了《关于<深圳文科园林股份有限公司限制性股票激励计划(草案)>及其摘要的议案》等相关议案,公司独立董事对上述事项发表了一致同意的独立意见。

2.2016年6月15日,公司召开 2016年第一次临时股东大会,审议通过了《关于<深圳文科园林股份有限公司限制性股票激励计划(草案)>及其摘要的议案》、《关于<深圳文科园林股份有限公司限制性股票激励计划实施考核管理办法>的议案》、《关于将实际控制人李从文、赵文凤夫妇作为股权激励对象的议案》、《关于将实际控制人李从文、赵文凤夫妇的近亲属李财宝先生、祝福浩先生、赵海龙先生作为股权激励对象的议案》、《关于提请股东大会授权董事会办理公司限制性股票激励计划有关事项的议案》、《关于提请股东大会进一步授权董事会调整限制性股票激励对象名单及激励对象间激励股数分配的议案》,公司实施激励计划获得批准。

3.2016年7月8日,公司召开第二届董事会第二十次会议和第二届监事会第十一次会议,审议通过了《关于调整限制性股票激励计划授予数量、授予价格及回购价格的议案》、《关于调整限制性股票激励对象名单的议案》、《关于向激励对象授予限制性股票的议案》,2015年度利润分配方案于2016年7月7日实施完毕,公司限制性股票授予的数量由400万股调整为800万股,每一位激励对象授予股数相应调整。限制性股票的授予价格和回购价格由19.08元调整为9.44元。根据公司2016年第一次临时股东大会的授权,董事会同意以2016年7月8日为限制性股票授予日,向212名激励对象授予800万股限制性股票。公司独立董事对此发表了同意的独立意见。

4.2016年7月22日,公司发布了《关于限制性股票授予完成的公告》(2016–035),公司董事会完成了限制性股票的授予登记工作。授予限制性股票的上市日期为2016年7月25日。

5.2017年7月14日, 公司召开第二届董事会第二十九次会议和第二届监事会第十八次会议,审议通过了《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的议案》及《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的议案》。

二、本次部分激励股份回购注销的原因、数量、价格及资金来源

(一)回购注销的原因

根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,夏树林、曹莉因个人原因离职而失去激励资格,公司将回购注销上述2名激励对象已授予但尚未解锁的限制性股票共20,000股。

(二)回购注销的数量

公司本次回购注销的上述2名激励对象已获授但尚未解锁的限制性股票数量共20,000 股。本次回购注销完成后,公司股份总数将由248,000,000股变更为247,980,000 股。

(三)回购注销的价格

根据公司《限制性股票激励计划》以及相关法律、法规的规定,若公司发生资本公积转增股本、派送股票红利、股份拆细、配股或缩股、派息等事项,公司应对尚未解锁的限制性股票的回购价格做相应的调整。

自激励对象获授公司限制性股票之日起至审议本事项期间, 公司实施了2015年度利润分配方案,向全体股东每 10 股派发2元人民币现金,同时以资本公积金向全体股东每10股转增10股,公司限制性股票激励计划所涉限制性股票的回购价格由19.08元/股调整为9.44元/股; 公司实施了2016年度利润分配方案,向全体股东每 10 股派发现金红利 1.00 元,公司限制性股票激励计划所涉限制性股票的回购价格由9.44元/股调整为9.34元/股。因此,本次限制性股票的回购价格为9.34元/股。

(四)回购的资金来源

公司本次回购注销的资金来源为自有资金,回购资金总金额为186,800元。

三、本次回购注销完成后股份变动情况表

股份性质	本次变动前		本次增减额	本次变动后	
	数量(股)	比例	数量(股)	数量(股)	比例
一、限售条件流通股/非流通股	133,680,000	53.90%	–20,000	133,660,000	53.90%
高管锁定股	7,800,000	3.15%	0	7,800,000	3.15%
股权激励限售股	8,000,000	3.23%	–20,000	7,980,000	3.22%
首发前限售股	117,880,000	47.53%	0	117,880,000	47.54%
二、无限售条件流通股	114,320,000	46.10%	0	114,320,000	46.10%
三、总股本	248,000,000	100.00%	–20,000	247,980,000	100.00%

四、本次回购注销对公司业绩的影响

本次回购注销部分激励股份事项不会对公司的经营业绩产生重大影响, 也不会影响公司管理团队的勤勉尽职。公司管理团队将继续认真履行工作职责,尽力为股东创造最大价值。

五、后续安排

本次回购注销完成后,公司限制性股票激励计划将按照法规要求执行。

六、独立董事意见

根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,公司原激励对象夏树林、曹莉因离职已不符合激励条件,我们同意公司回购注销其已获授但尚未解锁的限制性股票。

公司本次回购注销行为符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关事项备忘录1–3号》等法律、法规和规范性文件及《限制性股票激励计划》的相关规定,未损害公司及全体股东的利益,不会对公司的经营业绩产生重大影响,也不会影响公司管理团队的勤勉尽职。

七、监事会意见

经公司全体监事审议,一致认为:公司原激励对象夏树林、曹莉因离职已不符合激励条件。根据公司《限制性股票激励计划》的规定,公司将回购注销其已获授但尚未解锁的限制性股票共20,000 股,回购价格为9.34元/股。公司本次回购注销已离职股权激励对象所持已获授但尚未解锁的限制性股票的程序符合相关规定,同意公司回购注销其已获授但尚未解锁的限制性股票。

八、律师出具的法律意见

北京国枫律师事务所认为:

公司已就本次回购注销事宜履行了现阶段必要的法律程序,文科园林本次回购注销的事由、数量、回购价格均符合《公司法》、《证券法》、《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关事项备忘录1–3号》、《公司章程》及《激励计划》的相关规定。同时,公司应就本次回购注销激励股份及时履行信息披露义务并按照《公司法》等法律法规的规定办理减少注册资本和股份注销登记等手续。

九、备查文件

1.第二届董事会第二十九次会议决议
2.第二届监事会第十八次会议决议
3.独立董事对第二届董事会第二十九次会议相关事项的独立意见
4.北京国枫律师事务所关于深圳文科园林股份有限公司2016年限制性股票激励计划之限制性股票第一次解锁及回购注销部分限制性股票相关事项的法律意见书

特此公告

深圳文科园林股份有限公司董事会
二〇一七年七月十四日

证券代码:002775　　证券简称:文科园林　　公告编号:2017–048

深圳文科园林股份有限公司关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的公告

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

深圳文科园林股份有限公司(以下简称"公司")于2017年7月14日召开了公司第二届董事会第二十九次会议,审议通过了《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的议案》,董事会认为《限制性股票激励计划》(以下简称"《激励计划》")设定的限制性股票的第一个解锁期解锁条件已经成就,根据《激励计划》的相关规定,公司董事会将办理限制性股票中符合解锁条件部分的股票解锁事宜。公司董事会办理本次解锁事宜已经公司 2016 年第一次临时股东大会授权,无需再提交股东大会审议。现将相关事项公告如下:

一、公司限制性股票激励计划概述

1.2016年3月22日, 公司分别召开第二届董事会第十七次会议和第二届监事会第八次会议,审议通过了《关于<深圳文科园林股份有限公司限制性股票激励计划(草案)>及其摘要的议案》等相关议案,公司独立董事对上述事项发表了一致同意的独立意见。

2.2016年6月15日,公司召开 2016年第一次临时股东大会,审议通过了《关于<深圳文科园林股份有限公司限制性股票激励计划(草案)>及其摘要的议案》、《关于<深圳文科园林股份有限公司限制性股票激励计划实施考核管理办法>的议案》、《关于将实际控制人李从文、赵文凤夫妇作为股权激励对象的议案》、《关于将实际控制人李从文、赵文凤夫妇的近亲属李财宝先生、祝福浩先生、赵海龙先生作为股权激励对象的议案》、《关于提请股东大会授权董事会办理公司限制性股票激励计划有关事项的议案》、《关于提请股东大会进一步授权董事会调整限制性股票激励对象名单及激励对象间激励股数分配的议案》,公司实施激励计划获得批准。

3.2016年7月8日,公司召开第二届董事会第二十次会议和第二届监事会第十一次会议,审议通过了《关于调整限制性股票激励计划授予数量、授予价格及回购价格的议案》、《关于调整限制性股票激励对象名单的议案》、《关于向激励对象授予限制性股票的议案》,2015年度利润分配方案于2016年7月7日实施完毕,公司限制性股票授予的数量由400万股调整为800万股,每一位激励对象授予股数相应调整。限制性股票的授予价格和回购价格由19.08元调整为9.44元。根据公司2016年第一次临时股东大会的授权,董事会同意以2016年7月8日为限制性股票授予日,向212名激励对象授予800万股限制性股票。公司独立董事对此发表了同意的独立意见。

4.2016年7月22日,公司发布了《关于限制性股票授予完成的公告》(2016–035),公司董事会完成了限制性股票的授予登记工作。授予限制性股票的上市日期为2016年7月25日。

5.2017年7月14日, 公司召开第二届董事会第二十九次会议和第二届监事会第十八次会议,审议通过了《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的议案》及《关于<限制性股票激励计划>第一个解锁期解锁条件成就的议案》。

二、限制性股票激励计划第一个解锁期解锁条件成就的说明

(一)限制性股票第一个锁定期届满

根据公司《激励计划》,本激励计划授予的限制性股票自授予之日起12个月内为锁定期,锁定期满后为解锁期。第一次解锁期为自授予日起12个月后的首个交易日起至授予日起24个月内的最后一个交易日当日止,第一个解锁期可解锁数量占获授限制性股票数量比例的50%。公司限制性股票的授予日为2016 年7月8日, 授予的限制性股票第一个锁定期已于 2017 年7月8日届满。

(二)限制性股票第一个解锁期解锁条件成就的说明

公司董事会对限制性股票激励计划第一个解锁期规定的条件进行了审查,均满足解锁条件。

序号	激励计划设定的第一期解锁条件	是否满足解锁条件的说明
1	本公司未发生如下任一情形:(1)最近一个会计年度财务会计报告被注册会计师出具否定意见或者无法表示意见的审计报告;(2)最近一年内因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚;(3)中国证监会认定的其他情形。	公司未发生前述情形,满足解锁条件。
2	激励对象未发生以下任一情形:(1)最近三年内被证券交易所公开谴责或宣布为不适当人员;(2)最近三年内因重大违法违规行为被中国证监会予以行政处罚;(3)具有《公司法》规定的不得担任公司董事及高级管理人员的情形;(4)公司董事会认定的其他严重违反公司有关规定的情形。	激励对象未发生前述情形,满足解锁条件。
3	第一个解锁期公司业绩考核要求:相比2015年,2016年净利润增长率不低于40%(以上"净利润"指归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润,且为将在管理费用中列支的激励成本加回后的净利润)。	公司2016扣除非经常性损益的净利润,且为将在管理费用中列支的激励成本加回后的净利润为15,233.31万元,较2015年度增长57.17%。
4	锁定期内归属于上市公司股东的净利润及归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润均不得低于授予日前最近三个会计年度的平均水平且不得为负。	2016年归属于上市公司股东的净利润为13,957.05万元,不低于授予日前最近三个会计年度(2013–2015)的平均水平9,490.30万元;2016年归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润为13,549.81万元,不低于授予日前最近三个会计年度(2013–2015)的平均水平9,367.21万元。
5	个人层面绩效考核要求:根据个人年度绩效考评结果,划分为优、良、合格和不合格四挡,分别对应不同的可解锁比例: (1)考评结果为优、良的,可解锁个人当年解锁额度的100%; (2)考评结果为合格的,可解锁个人当年解锁额度的60%; (3)考评结果为不合格的,可解锁个人当年解锁额度的0%。	2016年度,212名激励对象中,有2名激励对象因个人原因辞职,不予解锁,其他210名激励对象绩效考核结果均为良好以上,可解锁个人当年解锁额度的100%。

综上所述,公司《激励计划》设定的第一个解锁期解锁条件已经成就,公司董事会将按照《激励计划》的相关规定办理限制性股票第一期解锁相关事宜。

三、本次实施的激励计划内容与已披露的激励计划是否存在差异的说明

本次实施的激励计划相关内容与公司已披露的限制性股票激励计划无差异。

四、本次可解锁限制性股票的激励对象及可解锁限制性股票数量

根据《激励计划》及公司《关于限制性股票授予完成的公告》(2016–035),本次授予的限制性股票解锁安排如下表所示:

解锁安排	解锁时间	解锁比例
第一次解锁	自授予日起12个月后的首个交易日起至授予日起24个月内的最后一个交易日当日止	50%

因此前共计二名激励对象离职,已不符合公司《激励计划》中有关激励对象的规定,本次符合解锁条件的激励对象共计210人,可解锁的限制性股票数量共计 399万股,占公司目前总股本的1.61%。

激励对象	职务	获受限制性股票数量(万股)	本期可解锁限制性股票数量(万股)	剩余未解锁数量(万股)
李从文	董事长	55	27.5	27.5
田守能	董事兼总经理	50	25	25
高育慧	董事兼常务副总经理	40	20	20
孙 潜	常务副总经理	30	15	15
赵文凤	董事兼副总经理	20	10	10
叶定良	副总经理	20	10	10
陈孝伟	副总经理	24	12	12
李 俊	副总经理	30	15	15
吴仲起	副总经理兼董秘	60	30	30
李鹏远	副总经理	20	10	10
程智鹏	副总经理	20	10	10
聂 勇	财务总监	20	10	10
关键管理人员、核心业务(技术)人员(198)		409	204.5	204.5
合计		798	399	399

五、董事会薪酬与考核委员会关于对公司 2016 年限制性股票激励计划激励对象第一期解锁的核查意见

本次可解锁激励对象符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励备忘录 1–3号》及公司《激励计划》等相关规定,在考核年度内考核结果均为良好以上,且符合其他解锁条件,可解锁的激励对象的资格合法、有效。

六、独立董事意见

经核查,公司2016年度的经营业绩、拟解锁的210名激励对象及其个人绩效考核等实际情况,均符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关事项备忘录 1–3 号》及公司《激励计划》中关于限制性股票激励计划第一期解锁条件的要求,解锁条件已经成就。

七、监事会意见

公司监事会对激励对象名单进行核查后认为,公司210名激励对象解锁资格合法有效,满足公司《激励计划》对授予的限制性股票设定的第一个解锁期解锁条件,并同意公司按照相关规定为激励对象办理第一期解锁手续。

八、律师出具的法律意见

北京国枫律师事务所认为:

公司本次解锁的各项条件已满足,且已根据《激励计划》就本次解锁履行了现阶段应当履行的审批程序,符合《上市公司股权激励管理办法(试行)》、《股权激励有关事项备忘录 1–3 号》及《激励计划》的相关规定,尚待统一办理符合解锁条件的限制性股票的解锁事宜。

九、备查文件

1.第二届董事会第二十九次会议决议
2.第二届监事会第十八次会议决议
3.独立董事对第二届董事会第二十九次会议相关事项的独立意见
4.北京国枫律师事务所关于深圳文科园林股份有限公司2016年限制性股票激励计划之限制性股票第一次解锁及回购注销部分限制性股票相关事项的法律意见书

特此公告

深圳文科园林股份有限公司董事会
二〇一七年七月十四日

证券代码:002775　　证券简称:文科园林　　公告编号:2017–049

深圳文科园林股份有限公司关于回购注销部分限制性股票的减资公告

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

深圳文科园林股份有限公司(以下简称"公司")于2017年7月14日召开了公司第二届董事会第二十九次会议,审议通过了《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的议案》。鉴于原激励对象夏树林、曹莉因个人原因离职,已不符合激励条件,根据公司《限制性股票激励计划》的相关规定,公司将回购注销上述激励对象已获授但尚未解锁的限制性股票20,000股。因此公司总股本将从24,800万股减至24,798万股。《关于对<限制性股票激励计划>部分激励股份回购注销的公告》详见指定信息披露媒体巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。

本次公司回购注销部分股权激励股份将涉及注册资本减少,根据《中华人民共和国公司法》等相关法律、法规的规定,公司特此通知债权人,债权人自本公告之日起四十五日内,有权要求本公司清偿债务或者提供相应的担保。债权人未在规定期限内行使上述权利的,本次回购注销将按法定程序继续实施。

本公司各债权人如要求本公司清偿债务或者提供相应担保的,应根据《公司法》等相关法律法规的规定,向公司提出书面要求,并随附相关证明文件。

特此公告

深圳文科园林股份有限公司董事会
二〇一七年七月十四日