

# 中加丰润纯债债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

(2017年第1号)

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	占基金资产净值比例(%)
1	138025	13国债025	300,000	20,181,000.00	9.08
2	140027	14国债027	200,000	21,444,000.00	9.24
3	01160977	01国债0977	200,000	19,990,000.00	8.81
4	01610409	16国债0409	200,000	19,979,000.00	8.80
5	01170018	17国债0018	200,000	19,974,000.00	8.80

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

本基金报告期末未持有权证。

9、报告期末未投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未运用股指期货进行交易。

10、报告期末未投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资情况

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

(2)报告期末未投资的国债期货投资持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

(3)本期国债期货投资评价

无。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

(2)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)其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,481.83
2	应收申购赎回款	896,162.64
4	应收利息	5,300,216.01
5	应收股利	-
6	其他	-
9	合计	6,286,060.39

(4)报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

本基金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。

(九)基金业绩

1、本基金业绩比较基准

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准标准差	①-③	②-④
2016年6月17日至2016年12月31日	76.41%	6.30%	-1.16%	0.11%	76.57%	6.19%
2017年1月1日至2017年3月31日	1.21%	0.08%	-1.24%	0.07%	2.45%	0.01%

中加丰润纯债债券C

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准标准差	①-③	②-④
2016年6月17日至2016年12月31日	-0.20%	0.07%	-1.16%	0.11%	0.96%	-0.04%
2017年1月1日至2017年3月31日	1.17%	0.08%	-1.24%	0.07%	2.41%	0.01%

2、自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其他比较



注:1.本基金基金合同于2016年6月17日生效,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2.根据基金合同的约定,本基金建仓6个月。截至建仓期结束,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;
- 基金销售服务费;
- (基金合同)生效后与基金相关的信息披露费;
- (基金合同)生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、审计费和仲裁费;
- 基金的持有人大会费用;
- 基金的投资、期货交割费用等因基金投资而产生的费用;
- 基金银行账户费用;
- 证券账户开户费用、账户维护费用;
- 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可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:

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假期等,支付日期顺延。

2.基金销售服务费

本基金A类基金份额的销售服务费, C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假期等,支付日期顺延。

3.其他基金费用

本基金A类基金份额前10日的销售服务费

B/C类基金份额前10日的销售服务费

H为基金份额前10日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假期等,支付日期顺延。

上述“其他基金费用”包括:1.0%费用,根据相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。

下列费用不列入基金费用:

- 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;
  - 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;
  - (基金合同)生效前的相关费用;
  - 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调整基金管理费率、基金销售服务费、基金销售服务费等相关费率。
- 调高基金管理费率、基金销售服务费率等,须召开基金份额持有人大会审议(法律法规和中国证监会另有规定的除外);调低基金销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。
- 基金管理人必须紧跟于新的费率实施日期按照《信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。
- (五)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。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

注:由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	11,982,800.00	-	8.17
2	000002	万科A	-	-	-
3	000004	比亚迪	-	-	-
4	000005	格力电器	-	-	-
5	000006	万科H	-	-	-
6	000007	中国宝安	-	-	-
7	000008	中兴通讯	-	-	-
8	000009	深大通	-	-	-
9	000010	深赛格	-	-	-
10	000011	航发动力	-	-	-
合计			29,572,800.00	11,004	

注:由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

6、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	占基金资产净值比例(%)
1	国债	11,982,800.00	8.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	18,793,560.00	66.48
5	企业短期融资券	100,800,000.00	47.29
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	6,286,060.39	2.26
9	合计	29,572,800.00	10.00

注:由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

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股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

注:由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	占基金资产净值比例(%)
1	138025	13国债025	300,000	20,181,000.00	9.08
2	140027	14国债027	200,000	21,444,000.00	9.24
3	01160977	01国债0977	200,000	19,990,000.00	8.81
4	01610409	16国债0409	200,000	19,979,000.00	8.80
5	01170018	17国债0018	200,000	19,974,000.00	8.80

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

本基金报告期末未持有权证。

9、报告期末未投资的股指期货交易情况说明

本报告期内,本基金未运用股指期货进行交易。

10、报告期末未投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资情况

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

(2)报告期末未投资的国债期货投资持仓和损益明细

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

(3)本期国债期货投资评价

无。

11、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

(2)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)其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,481.83
2	应收申购赎回款	896,162.64
4	应收利息	5,300,216.01
5	应收股利	-
6	其他	-
9	合计	6,286,060.39

(4)报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

本基金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。

(九)基金业绩

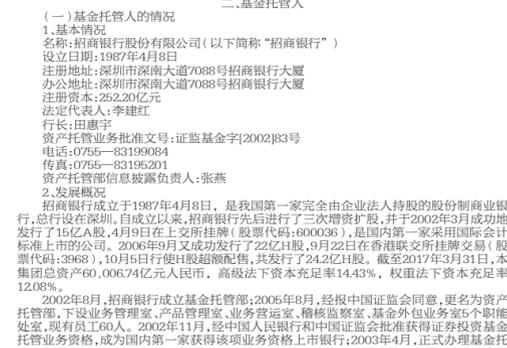
1、本基金业绩比较基准

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准标准差	①-③	②-④
2016年6月17日至2016年12月31日	76.41%	6.30%	-1.16%	0.11%	76.57%	6.19%
2017年1月1日至2017年3月31日	1.21%	0.08%	-1.24%	0.07%	2.45%	0.01%

中加丰润纯债债券C

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准标准差	①-③	②-④
2016年6月17日至2016年12月31日	-0.20%	0.07%	-1.16%	0.11%	0.96%	-0.04%
2017年1月1日至2017年3月31日	1.17%	0.08%	-1.24%	0.07%	2.41%	0.01%

2、自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其他比较



注:1.本基金基金合同于2016年6月17日生效,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

2.根据基金合同的约定,本基金建仓6个月。截至建仓期结束,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;
- 基金销售服务费;
- (基金合同)生效后与基金相关的信息披露费;
- (基金合同)生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、审计费和仲裁费;
- 基金的持有人大会费用;
- 基金的投资、期货交割费用等因基金投资而产生的费用;
- 基金银行账户费用;
- 证券账户开户费用、账户维护费用;
- 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可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:

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假期等,支付日期顺延。

2.基金销售服务费

本基金A类基金份额的销售服务费, C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假期等,支付日期顺延。

上述“其他基金费用”包括:1.0%费用,根据相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。

下列费用不列入基金费用:

- 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;
  - 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;
  - (基金合同)生效前的相关费用;
  - 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调整基金管理费率、基金销售服务费、基金销售服务费等相关费率。
- 调高基金管理费率、基金销售服务费率等,须召开基金份额持有人大会审议(法律法规和中国证监会另有规定的除外);调低基金销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。
- 基金管理人必须紧跟于新的费率实施日期按照《信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

注:由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	11,982,800.00	-	8.17
2	000002	万科A	-	-	-
3	000004	比亚迪	-	-	-
4	000005	格力电器	-	-	-
5	000006	万科H	-	-	-
6	000007	中国宝安	-	-	-
7	000008	中兴通讯	-	-	-
8	000009	深大通	-	-	-
9	000010	深赛格	-	-	-
10					