

创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金招募说明书 更新 摘要

(2018年第1号)

基金管理人:创金合信基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
截止日:2018年01月07日

重要提示

本基金经中国证监会2015年12月25日证监许可[2015]3078号文注册募集。本基金的基金合同于2016年1月7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。本基金经中国证监会注册,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投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证,也不表明其对本基金没有风险。

本基金为债券型基金,长期来看,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。

投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:基金特定的投资品种相关的特定风险,因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险,因基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,因投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险,基金投资过程中产生的运作风险以及不可抗力风险等。其中,基金特定的投资品种相关的特定风险指投资中小企业私募债等非公开发行的债券品种因信息披露不充分而可能发生的流动性风险、信用风险,以及因单一投资者申购比例上限而导致的部分确认或无法确认的风险等。本基金的一般风险及特定风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金的《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,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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,基金运营状况导致的投资风险,由投资者自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年1月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日(未经审计)。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:创金合信基金管理有限公司
 住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
 办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦16层
 法定代表人:刘学民
 成立日期:2014年7月9日
 联系电话:0755-23838000
 联系人:王晶晶
 组织形式:有限责任公司
 注册资本:人民币1.7亿元
 股权结构

股东名称	出资比例
第一创业证券股份有限公司	70%
深圳市创金合信投资合伙企业(有限合伙)	30%
总计	100%

二、主要人员情况

1.董事会成员基本情况

公司董事会共有7名成员,其中1名董事长,3名董事,3名独立董事。
 刘学民先生,董事长,研究生,国籍:中国。历任北京市计划委员会外经处副处长、北京京政经济发展公司总经理,佛山证券有限责任公司董事长,现任第一创业证券股份有限公司董事长、第一创业投资管理有限公司董事、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事、国泰新(北京)节水投资基金管理有限公司董事、深圳第一创业元创投资管理有限公司董事、北京第一创业圆创资本管理有限公司董事、深圳第一创风华文化投资管理有限公司董事、北京第一远航投资管理有限公司董事长、普创(珠海)投资管理有限公司董事长、法人代表、创金合信基金管理有限公司董事长、法定代表人。
 苏彦祝先生,董事,硕士,国籍:中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理、投资部执行总监、投资部总经理、第一创业证券股份有限公司副经理兼资产管理部总经理,现任创金合信基金管理有限公司董事、总经理。

黄越岷先生,董事,硕士,国籍:中国。历任佛山市计量所工程师、佛山市诚信税务师事务所副经理,第一创业证券股份有限公司信息技术部总经理助理、清算运营部总经理、资产管理部运营与客席负责人,现任创金合信基金管理有限公司董事、公司副总经理。
 刘红霞女士,董事,本科,国籍:中国。历任广东省香江集团人力资源部副总经理、中国建材集团下属新家居/易好家电器连锁有限公司人力资源部总监、顺丰快递集团人事处总经理,现任第一创业证券股份有限公司董事,第一创业证券承销保荐有限责任公司监事,深圳市德福科技集团有限公司执行董事,北京第一创业圆创资本管理有限公司董事长,深圳第一创业元创投资管理有限公司董事长,第一创业投资管理有限公司董事长、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事长、深圳莱创文化产业园投资管理有限公司董事长、深圳一创弘宇投资管理有限公司法人代表、执行董事、总经理,深圳一创泰和投资管理有限公司董事长、珠海一创弘宇投资管理有限公司董事长、珠海一创智昇投资管理有限公司董事长,一创道胜资产管理(青岛)有限公司董事长、深圳一创汇智股权投资管理有限公司法人代表、董事长、普创(珠海)投资管理有限公司董事,珠海一创众创大数据投资有限公司董事,中关村顺势一创(北京)投资管理有限公司法人代表、董事长、珠海一创中金投资管理有限公司法人代表、董事,浙江一创电建资产管理有限公司董事,深圳市鲲鹏一创股权投资管理有限公司董事,上海浦银汇理投资管理有限公司董事,广东恒健新兴产业投资管理有限公司董事,创金合信基金管理有限公司董事。

陈基华先生,独立董事,硕士,高级会计师,国籍:中国。历任中国诚信证券评估有限公司经理、红牛维他命饮料有限公司财务总监、ALJ(中国)有限公司财务总监、吉通网络通讯股份有限公司副总裁、财务总监、中国铝业股份有限公司执行董事、副总裁、财务总监、农银汇理基金管理有限公司董事、中银海外控股有限公司北京、中国太平洋保险(集团)有限公司副总裁,现任北京莱创资本管理有限公司总裁、中铁高新工业股份有限公司独立董事、江苏沃田集团董事、黄山永新股份有限公司、创金合信基金管理有限公司独立董事。
 清津良先生,独立董事,研究生,国籍:中国。于1970年12月-1975年3月服役;1975年4月起历任北京照相厂总厂职工、北京经济学院劳动经济系教师、北京市西城区委办公室干部、副主任,北京市委办公厅副处长,北京市政府休办调研处、研究室处长,建设银行信托投资公司房地产业务部总经理、海南代表处主任、海南建信投资管理有限公司总经理,信达信托投资公司总裁助理、总裁办主任兼基金部总经理,信达投资有限公司总裁助理兼总裁办主任,中国经济发展有限责任公司副总经理、总经理、董事长、党委书记、党委书记、名誉董事长。现任创金合信基金管理有限公司独立董事。
 徐肇宏先生,独立董事,学士,国籍:中国。曾就职于北京市皮革工业公司、中国人民银行、中国工商银行,1999年12月-2015年5月历任中国华融资产管理公司人力资源部总经理、组织部部长、北京办事处总经理、党委书记,公司总裁助理、党委委员、副总裁。现任创金合信基金管理有限独立董事。

2.监事基本情况

公司不设监事会,设监事会一名,职工监事一名。
 杨健先生,监事,博士,国籍:美国。历任华北电力设计院(北京)工程师,GE Energy(通用电气能源集团)(中国),ABB Inc.项目经理,新英格兰电力交易与调频中心首席分析师,通用电气能源投资公司助理副总裁,花旗集团高级副总裁,现任第一创业证券股份有限公司首席风险监控管理部负责人、创金合信基金管理有限公司监事。
 殷少珍女士,职工监事,国籍:中国。历任第一创业证券股份有限公司经纪业务部营销管理、东莞营业部运营总监、资产管理部综合运营主管。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司。

3.高级管理人员基本情况

刘学民先生,董事长、法定代表人,简历同前。
 苏彦祝先生,总经理,简历同前。
 梁绍锋先生,督察长,硕士,国籍:中国。历任中国国际贸易促进委员会深圳分会法务主管,世纪证券有限责任公司合规专员,第一创业证券股份有限公司法律合规部副总经理,现任创金合信基金管理有限公司督察长。
 黄先智先生,副总经理,硕士,国籍:中国。历任湖南浏阳枫林花炮厂销售经理,第一创业证券股份有限公司资产管理部高级投资助理、固定收益部投资经理,资产管理部产品研发与创新业务负责人兼交易部负责人。现任创金合信基金管理有限公司副总经理。
 黄越岷先生,副总经理,简历同前。

刘逸心女士,副总经理,学士,国籍:中国。历任中国工商银行北京市分行个人金融业务部项目经理、上投摩根基金管理有限公司北京分公司北方区域渠道业务总监、第一创业证券股份有限公司资产管理部市场部负责人,现任创金合信基金管理有限公司副总经理。
 张雪松先生,副总经理,博士,国籍:中国。历任广东发展银行深圳分行信贷员,深圳市太阳海岸国际旅游发展有限公司财务经理,南方基金管理有限公司养老金及机构理财部总监助理、基金经理、养老金业务部总监、机构业务部总监,第一创业证券股份有限公司资产管理部私募业务战略部负责人,现任创金合信基金管理有限公司副总经理。

4.本基金的基金经理

王一兵先生,四川大学MBA。1994年即进入证券期货行业,作为公司出市代表任海南中商期货交易所红马甲,1997年进入股指期货,经历了各种证券市场的大幅涨跌变化,拥有成熟的投资心态和丰富的经验。曾历任第一创业证券固定收益部高级交易经理,资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。现任创金合信基金管理有限公司固定收益部负责人。熟悉债券市场和固定收益产品的各种投资技巧,尤其精通近两年发展迅速的信用债,对企业信用分析、定价有深刻独到的见解。
 郑振源先生,中国人民大学研究生部经济学硕士。2009年7月加入第一创业证券研究所,担任宏观债券研究员。2012年7月加入第一创业证券资产管理部,先后担任宏观债券研究员、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司,现任基金经理。

5.基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

苏彦祝先生,创金合信基金管理有限公司董事、总经理
 陈玉辉先生,创金合信基金管理有限公司投资一部总监
 曹春林先生,创金合信基金管理有限公司基金经理
 王一兵先生,创金合信基金管理有限公司固定收益部总监
 张荣先生,创金合信基金管理有限公司基金经理
 薛静女士,创金合信基金管理有限公司总经理助理
 程志田先生,创金合信基金管理有限公司量化投资部总监
 上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人概况

1.基本情况
 名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
 设立日期:1987年4月8日
 注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
 办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
 注册资本:252.20亿元
 法定代表人:李建红

行长:田惠平
 资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
 电话:0755-83199084
 传真:0755-83196201
 资产托管部信息披露负责人:张燕

2.发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿美元,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿美元,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿股。截至2017年9月30日,本集团总资产61,692.39亿元人民币,高级法下资本充足率15.01%,权重法下资本充足率12.26%。

2008年2月,招商银行成立基金托管部;2008年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务运营室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工76人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(ODII)、全国社保基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念,和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值,独创“6S托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权投资基金、第一只美国贸易市场商品基金、第一只TOT、第一只境外货币ETF基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财,第一家大小非解禁资产,第一单TOT保管,实现从单一托管服务向全方位投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获此奖项国内托管银行;“托管通”获得国内《贝壳奖》2016年中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳托管银行奖”;2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,“全能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017年中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”,进一步扩大招商银行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

二、主要人员情况

李建红先生,招商银行董事长,非执行董事,2014年7月起担任招商银行董事、董事长。英国伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,招商银行行长、执行董事,2013年5月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生,招商银行副行长,货币银行学硕士,高级经济师,1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行总行助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行总行行长助理;2015年1月起担任招商银行副行长;2016年11月起兼任招商银行董事兼秘书。

姜英女士,招商银行资产托管部副总经理,大学本科学历,具有基金托管高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江大学分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、总账管理工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、运营助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发之一,具有20余年银行信贷及托管专业工作经验。在托管资产创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况
 截至2017年9月30日,招商银行股份有限公司累计托管316只开放式基金。
 四、托管人的内部控制制度
 1.内部控制目标
 确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于识别风险、增强漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时、确保内部控制,体系的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。
 2.内部控制组织结构
 招商银行资产托管部设立三级内控风险防范体系:一级风险防范是总行层面对于风险的识别和控制。二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险防范和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督,及时发现内部控制缺陷,提出整改方案,跟踪整改情况。
 三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时,必须遵循内部控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。
 五、内部控制原则
 (1)全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节,覆盖所有室和岗位,并由全部人员参与。
 (2)审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险,托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防风险、审慎经营为出发点,应当体现“内控优先”的要求。
 (3)独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产的建立、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制应当独立于内部控制的建立和执行部门,稽核监察室应保持高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。
 (4)有效性原则。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的反馈和纠正。
 (5)适应性原则。内部控制应适应招商银行资产托管业务风险管理需要,并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时修订和完善。
 (6)防火墙原则。业务运营、稽核监察等室,应当在制度上和人员上适当分离,办公网络和业务网络分离,部门业务网络和全行业务网络分离,以达到风险防范的目的。
 (7)重要性原则。内部控制应当在全行控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。
 (8)制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。
 (9)成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益,以适当的成本实现有效控制。

4.内部风险控制措施
 (1)完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内部控制办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度,从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作,切实履行托管业务当事人的利益,避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理,招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》,并建立了灾难备份中心,各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份,确保灾难发生时,托管业务迅速恢复和不间断运行。
 (2)经营风险管理控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人岗、大额资金专人复核、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作程序,有效地控制业务运作过程中的风险。
 (3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据,数据执行异地同步备份,同时,每日实时对托管业务数据库进行备份,托管业务数据每日进行备份,所有的业务信息必须经过严格的授权才能进行访问。
 (4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料,视同客户资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(5)信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理,电脑密码设置及权限管理,业务网和办公网、与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。
 (6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好企业文化和员工培训、激励机制,加强人力资源管理和建立人才梯队队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源管理。
 五、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
 根据《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》等有关证券投资基金法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金资产选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。
 基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人A的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定,应及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合有关法律法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定的时间内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,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投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人限期改正,如基金管理人未能在通知期限内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有关义务配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据托管协议规定进行监督或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1.直销机构
 直销机构:创金合信基金管理有限公司
 住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室
 办公地址:深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦16层
 法定代表人:刘学民
 传真:0755-82769149
 电话:0755-23838923
 邮箱:cjhzxhxxiao@cjhxfund.com
 联系人:欧小娟
 网站:www.cjhxfund.com
 2.其他销售机构
 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190号2号楼2层
 法定代表人:其实
 客服电话:4001818188
 网站:www.1234567.com.cn
 二、登记机构
 名称:创金合信基金管理有限公司
 住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室
 办公地址:深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦16层
 法定代表人:刘学民
 电话:0755-23838000
 传真:0755-82737441-0187
 联系人:古桂彬

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:安杰、陆奇
 联系人:安杰
 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:深圳市福田区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
 办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
 法定代表人:王俊俊
 电话:010-8508 5000
 传真:010- 8518 5111
 联系人:邵春娇、黄玉华
 总经办注册会计师:王丽蓉、程海良、邵春娇、黄玉华、刘婷婷

第四部分 基金的名称

第五部分 基金的类型

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险的前提下,追求当期收入和投资回报最大化。

本基金主要投资于固定收益类资产,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等。

本基金不参与从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购和新股增发。因所持可转换债券与可交换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10个交易日的时间内卖出。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可将其纳入投资范围。
 基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;本基金持有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%。

第七部分 基金投资策略

本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪,基于对利率、信用等市场的分析和预测,综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略,力争实现基金资产的稳健增值。
 1.久期配置策略
 本基金通过久期配置策略(包括国内生产总值、工业增加值、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸顺差、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析,预测未来的利率趋势,判断债券市场对上述变量和政策的反应,并据此对债券组合的平均久期进行调整,提高债券组合的总投资收益。

2.期限结构配置
 在确定组合久期后,针对收益率曲线特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯型策略,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3.债券类属配置策略
 在宏观分析及久期、期限结构配置的基础上,本基金根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付及时间、利息税务处理、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素,采取积极的投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权数。

4.信用风险控制
 基金管理人将充分利用现有行业与公司的研究力量,根据发债主体的经营状况和现金流等情况,对发债企业信用风险进行评估,并据此作为债券投资的依据以控制基金组合的信用风险。

5.跨市场套利策略
 跨市场套利是根据不同债券市场间的运行规律和风险特性,构建和调整债券组合,提高投资收益,实现跨市场套利。
 6.杠杆放大策略
 本基金可采用杠杆放大策略扩大收益,即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金,并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券,以期获取超额收益。

7.中小企业私募债投资策略
 本基金在控制信用风险的基础上,采取分散化投资的方式进行中小企业私募债的投资。基金管理人将紧密跟踪研究发债企业的基本情况,适时调整投资组合,控制投资风险。

8.资产支持证券投资策略
 本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,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、流动性风险溢价、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本基金运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析 and 度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

八、其他

未来,随着市场的发展和基金管理人运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,制定和调整更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

中债综合(全价)指数收益率
 如果该业绩比较基准发生变化,或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或市场上出现更加适用于本基金业绩比较基准时,在与基金托管人协商一致,基金管理人可根据本基金的投资目标和投资策略调整基金的业绩比较基准,但应在调整实施前公告并报中国证监会备案,无须召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 风险收益特征

本基金为债券型基金,长期来看,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告(未经审计)

本基金对报告期内的事项及重要事件在本报告所载内容不存在虚假记载、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。
 本基金的托管人根据基金合同的约定,复核了本报告的内容,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12月31日(未经审计)。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	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	620,153,698.80	97.47
其中:债券	486,684,112.50	93.45	
资产支持证券	21,469,586.30	4.02	
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	3,422,396.67	0.68
8	其他资产	9,865,820.15	1.56
9	合计	533,641,914.69	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。
 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.报告期末按投资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	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	80,028,000.00	15.70
其中:政策性金融债	39,784,000.00	7.81	
4	企业债券	271,462,500.00	53.27
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	128,014,000.00	25.12
7	可转换(可交换)	161,612.50	0.03
8	同业存单	19,028,000.00	3.73
9	其他	—	—
10	合计	488,684,112.50	97.85

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	占基金资产净值比例(%)
1	130446	14国债02	500,000	48,500,000.00	9.72
2	130258	14国债06	500,000	48,985,000.00	9.61
3	10166017	16浙商MTN001	500,000	48,630,000.00	9.54
4	130631	16南钢01	500,000	48,165,000.00	9.46
5	1420022	14国债02	400,000	40,244,000.00	7.90

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116102	三电债07	170,000	17,105,586.30	3.36
2	1688337	16顺元A	200,000	4,364,000.00	0.86

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持有股指期货。
 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持有国债期货。
 11.投资组合报告附注
 11.1 本基金未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 11.