

兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书 (更新 摘要)

(2019年第1号)

基金管理人：兴业基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

重要提示

本基金经2017年11月11日中国证监会监督管理委员会证监许可〔2017〕1964号文准予募集注册，基金合同于2018年6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投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人恪恪尽职守、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、基金合同等等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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，由于基金投资组合中连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人及基金财产实施过程中产生的基金投资风险，本基金的特有风险等。本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险的基金品种，其风险与收益预期高于货币市场基金，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。本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%，本基金不向个人投资者销售。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，由投资者自行承担。

本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于存在非公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发生流动性风险时，受市场流动性限制，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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并不构成对本基金业绩表现的保证。

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关系的基本法律文件。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合同的权利和义务，应仔细阅读基金合同。

本招募说明书中涉及及的托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年6月5日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年3月31日（本招募说明书中的财务资料未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人情况

名称：兴业基金管理有限公司
住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址：上海市浦东新区银城路167号13、14层
法定代表人：官恒秋
设立日期：2013年4月17日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]288号
组织形式：有限责任公司
注册资本：12亿元人民币
存续期限：持续经营
联系电话：021-22211888
联系人：郭玲燕
股权结构：

股东名称	出资比例
兴业银行股份有限公司	90%
中国集团投资有限公司	10%
合计	100%

（二）主要人员情况

1. 董事会成员

胡斌先生，董事长，硕士学位，高级经济师。曾任兴业银行国际业务部副总经理，兴业银行总行党委副书记、副行长，兴业银行杭州分行党委书记、行长，兴业银行南京分行党委书记、行长，兴业基金管理有限公司党委书记、董事长。

陈庆杰先生，董事，硕士学位，高级经济师。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输（集团）总公司资产管理部、资本运营部、资产运营部工作，历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表，中国远洋运输（集团）总公司、中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总经理、党委委员、中海集团投资有限公司副总经理。

胡斌先生，董事，硕士学位，经济师职称。曾任兴业银行乌鲁木齐分行企业金融总部营销管理部总经理，兴业银行总行企业金融总部企业金融营销管理部总经理助理，兴业银行北京分行党委委员、行长助理，兴业银行总行投资银行部副总经理等职务。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理，兼任兴业财富管理管理有限公司执行董事。

李春平先生，独立董事，博士学位，高级经济师。曾任国泰君安证券股份有限公司总裁助理，国泰基金管理有限公司总经理、执行董事，长江证券保险经纪有限公司党委书记、总裁，上海鼎晖资本管理有限公司执行董事，上海保险交易所中保保险资产登记交易委员会办公室副主任等职。现任杭州华福律师事务所总所主任。

陈华锋先生，独立董事，博士学位。曾任新加坡国立大学高商德学院金融学助理教授，美国纽约州立大学石溪分校金融学副教授（终身教职），清华大学五道口金融学院讲席副教授（终身教职）。现任复旦大学上海金融教学院教授、博士生导师，MBA项目学术主任。

陈文庆先生，独立董事，博士学位。曾任厦门大学会计系主任、博士生导师，厦门大学管理学院副院长，厦门大学研究生院副院长等职。现任对外经济贸易大学国际商学院教授。

2. 监事会成员

林榕辉先生，监事会主席，博士学位。曾任兴业银行总行风险管理部副总经理、信用审查部总经理、漳州分行党委书记、行长，同业业务部总经理、风险管理部总经理、研究规划部总经理、企业金融总部副总裁，金融市场总部副总裁等职务。现任兴业银行总行同业金融部总经理。

杜海英女士，监事，硕士学位。曾任中商（海南）海盛船务股份有限公司发展部部长、发展部副主任（主持工作）、发展部主任，中商中国物流（集团）总公司党校副校长，集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、中商集团投资有限公司副总经理，河南中商中际物流产业发展基金管理有限公司董事长。

殷振宇先生，职工监事，本科学历。曾任天弘基金管理有限公司广州分公司总经理助理，兴业银行总行资产管理部总行资产管理部综合处副处长，兴业基金管理有限公司综合管理部总经理、人力资源部副总经理等职。现任兴业基金管理有限公司综合管理部总经理。

榕桂婵女士，职工监事，硕士学位。曾任鞍山证券上海管理总部宏观研究员、富国基金交易部交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易部交易总监。现任兴业基金管理有限公司交易部总经理兼基金运营部总经理。

3. 公司高级管理人员

官恒秋先生，董事长，简历同上。

胡斌先生，总经理，简历同上。

王慧女士，督察长，本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理，兴业银行总行副行长，兴业银行信用审查部总经理，兴业银行小企业部总经理，兴业银行金融市场总部副经理、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生，副总经理，硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长，兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理，兴业银行厦门分行党委委员、行长助理，兴业银行总行投行部副总经理，兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张凯园先生，副总经理，本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理，深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理，商人银行部副总经理，深圳发展银行上海分行宝山支行副行长，兴业银行上海分行南汇支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理，兴业基金管理有限公司总经理助理，上海分公司总经理，上海兴晟股权投资管理有限公司总经理，兴投（平潭）资本管理有限公司执行董事。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

庄李强先生，总经理助理，本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经理，兴业银行总行审计稽核部财务处二处副处长、上海分行业务二处副处长，兴业银行总行资产管理部总经理助理，兴财财富资产管理（上海）总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理，兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

4. 本基金基金经理

（1）现任基金经理

徐甫先生，硕士学位。7年证券从业经验。2011年7月至2014年1月，在华泰证券股份有限公司研究所担任债券研究员，从事债券研究工作；2014年2月至2016年8月，在国联安基金管理有限公司债券估值及资产管理部从事债券投资研究工作，期间担任债券研究员和基金经理助理。其中2016年5月至2016年8月担任国联安德盛增利增强型证券投资基金的基金经理，2016年5月至2016年12月担任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金的基金经理，2016年9月至2016年10月担任国联安稳本混合型证券投资基金的基金经理助理，2016年10月加入兴业基金管理有限公司，2017年1月19日起担任兴业惠康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年5月9日起担任兴兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2017年5月9日至2019年6月26日担任兴业惠福债券型证券投资基金基金经理，2017年6月9日至2019年6月28日担任兴业惠融债券型证券投资基金（原兴业惠融灵活配置混合型证券投资基金）基金经理，2018年6月18日起担任兴兴18个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年6月18日起担任兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年6月27日起担任兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2019年2月22日起担任兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

熊伟先生，于2018年8月7日至2019年2月26日期间担任兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

5. 投资策略委员会成员

胡斌先生，总经理。

黄文锋先生，副总经理。

冯鸣女士，固定收益投资部负责人。

冯小波先生，基金经理。

徐童，基金经理。

滕博，基金经理。

陈子越先生，固定收益研究部总经理助理。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：
名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
成立日期：1992年10月19日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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、同业拆借；提供信用证服务及担保；代收代付款项及代收代缴业务；提供融资租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司
注册资本：293.52亿元人民币
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[2003]110号
联系人：胡波
联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自2003年开始开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持快速增长，

各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部，2005年更名为资产托管部，2013年更名为资产托管与养老金业务部，2016年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资产托管、资金托管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

（二）主要人员情况

高国富，男，1964年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国平安保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长，第十二届上海政协执委，伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副经理，上海市金融服务办挂职机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商银行授信科，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理助理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管运营部江南支行行长助理、副行长。

（三）基金托管业务经营情况

截止2019年3月31日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为4614.20亿元，比去年末增加9.62%。托管证券投资基金共一百五十六只，分别为国泰金兴行业精选基金、国泰金龙保本增值基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、华富保本混合型证券投资基金、中海稳略精选灵活配置混合基金、博时安丰18个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒时定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜债货币基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安民安灵活配置混合基金、安信价值策略灵活配置基金、国联安鑫禧混合基金、国联安鑫利混合基金、长安鑫利混合基金、工银瑞信生态环境主题基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、金鹰改革红利基金、易方达鑫利回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元产业债基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、国寿瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元纯债债券基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富元丰灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇智3个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉纯纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞福混合基金、华富成长一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招祥纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安源顺纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富睿瑞债券基金、鑫元丰华债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰鑫利纯债基金、华夏泛债货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启源灵活配置型证券投资基金、鹏华弘益混合基金、鹏华弘泰混合基金、鹏华弘康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、兴业安润灵活配置混合基金、长安鑫鑫领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧理货币市场基金、易方达瑞盈灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基金、民生加银聚鑫纯债债券型证券投资基金、万家天添宝货币基金、长安鑫鑫主题轮动混合基金、中欧瑞丰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置基金、泰康天序纯债一年定期开放债券基金、广发高邮制造驱动型发起式基金、永赢永益债券基金、南方富福混合基金、中银证券聚利债券基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富安纯债债券型证券投资基金、国联安稳盈灵活配置混合型证券投资基金、前海开源嘉鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国瑞利纯债债券型证券投资基金、华安睿源债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏华淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫腾纯债债券基金、新疆前海创合泓恒纯债债券基金、永赢鑫益债券型证券投资基金、中融固合纯债债券型证券投资基金、中信保诚达债债券型证券投资基金基金、中银中债1-5年期次发行指数证券投资基金、东方红双债优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安大华惠理纯债债券型证券投资基金、华夏红利纯债债券基金、鑫元全利债券基金、鑫元全利恒信债券基金、中融恒利纯债债券型证券投资基金、嘉实鑫源债券型证券投资基金、永赢鑫源主题灵活配置混合型证券投资基金、兴兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债1-3年期国开行债券指数证券投资基金、融通通债债券型证券投资基金、华富恒顺纯债债券型证券投资基金、建信中证100指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉纯纯债债券型证券投资基金、中欧臻泰债券型证券投资基金、国寿安邦保本纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、银河家颐纯债债券型证券投资基金、博时南元纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅时定期开放债券型发起式证券投资基金、中加加瑞纯债债券型证券投资基金、华安安享定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证5年恒定开债中短债指数证券投资基金、永赢鑫合债券型证券投资基金等。

（四）基金托管人的内部控制制度

1. 本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营机制。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2. 本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导各管理部建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险控制部是全行操作风险的牵头管理部门。指导各管理部开展资产托管业务的操作风险管理等工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务活动的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控管理人员负责托管业务的内控管理工作，独立履行监督稽核职责。

3. 内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度，内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和操作每个环节，覆盖到从事资产托管各组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务流程、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度，明确岗位职责及各项操作程序，员工职业道德规范，业务数据备份和保管等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区搭建健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控、排查及风险防范。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

1. 监督依据

托管人严格按照有关法律法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- 《《中华人民共和国证券法》》；
- 《《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》》；；
- 《《证券投资基金销售管理办法》》；
- 《《基金合同》》、《《基金托管协议》》；
- 法律、法规、政策的其他规定。

2. 监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，并及时提示管理人违规风险。

3. 监督方法

- （1）资产托管部设置合规监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资运作行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资者的合法权益，不受任何外界力量的干预；
- （2）在日常运作中，可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的实时监控和预警；
- （3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

4. 监督结果的处理方式

（1）若基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告，定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时报告、其他临时报告等；

- （2）若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、书面、邮件提醒的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人上述事项进行复查，如果基金管理人对其违规事项未予纠正，基金托管人将报告中国证监会，如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；
- （3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关资料或说明；

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1. 直销机构

（1）名称：兴业基金管理有限公司直销中心
住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
法定代表人：官恒秋
办公地址：上海市浦东新区银城路167号13、14层
联系人：金晨
电话：021-22211885
传真：021-22211997
网址：http://www.cib-fund.com.cn

2. 其他销售机构

其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

（二）登记机构

名称：兴业基金管理有限公司
住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址：上海市浦东新区银城路167号13、14层
法定代表人：官恒秋
设立日期：2013年4月17日
联系电话：021-22211899
联系人：金晨
（三）出具法律意见的律师事务所
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
办公场所：上海市银城中路68号时代金融中心10楼
负责人：俞卫锋
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陈福华

经办律师：黎明、陈福华

（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：上海市延安东路222号外滩中心30楼

执行事务合伙人：黄震

电话：021-6141 1888

传真：021-6335 0771/0377

联系人：曾浩

经办注册会计师：曾浩、吴凌志

四、基金名称

兴兴3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

五、基金的投资目标

六、基金份额的封闭期和开放期

（一）基金的封闭期

本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回等业务，也不上市交易。

（二）基金的开放期

本基金每3个月开放一次，每次开放期最长不超过20个工作日，每个开放期的首日为基金合同生效日所在月份在后续每个日历月中最后一个日历日的首个工作日。

开放期的具体时日以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期开始前2日进行公告。如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回等业务的，或依据基金合同需暂停申购或赎回等业务的，开放期间顺延，直至满足开放期的前提要求，具体时日以基金管理人届时公告为准。

假设基金合同生效日为2017年9月11日，则基金合同生效日所在月份在后续每个3日历月中最后一个日历日即为2017年12月1日、2018年3月1日、2018年6月1日、2018年9月1日等等（以此类推）。2017年12月1日为工作日，则本基金第一个开放期的首日为2017年12月1日。开放期最长不超过20个工作日，开放期的具体时日以基金管理人届时公告为准，则基金管理人最迟应于开放期开始前2日（即2017年11月29日）进行公告，以此类推。

七、基金的投资目标

本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、证券公司短期公司债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具及法律法规和中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不直接买入股票或权证，不对投资可转换债券及分离交易可转债上市前分离出来的债券。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

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，每个开放期开始前10个工作日及开放期结束后10个工作日内，本基金投资不受前述比例限制。开放期内，基金持有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%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。

九、基金的投资策略

（一）基金的投资策略

本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

1. 封闭期投资策略

（1）资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策变化及资金供需情况的分析，把握大类资产的预期收益水平、利差水平、风险水平，在有效控制风险的基础上，动态调整基金大类资产的投资比例，力争为基金资产获取稳健回报。

（2）久期策略

本基金将通过宏观经济变量和宏观政策等进行定性及定量分析，在考虑封闭期剩余期限的基础上，进而对市场利率水平和利率走势等进行合理的预测和判断。

当预期市场利率水平将上升时，适当降低组合的久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益的目的。

（3）信用债券投资策略

信用类债券是本基金重要投资标的，信用风险评估对于提高债券组合收益至关重要。

本基金将根据宏观经济运行状况、行业发展前景、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评价信用评级风险，确定信用类债券的信用评级等级，有效管理组合的整体信用风险。同时，本基金将运用本基金管理人比较完善的信用评级体系，对信用评级发行人基本面的深入调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评价结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

（4）类属配置策略

不同类型的债券其收益性、流动性和信用风险上存在差异，债券资产不同类别配置于不同类型的品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险之间的最佳平衡点。本基金将综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的结果来决定投资配置的类别别资产配置策略。

（5）个券选择策略

本基金根据债券市场收益率水平，在综合考虑债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素的基础上，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在确定债券组合久期之后，本基金将通过对不同信用等级类别的收益率差异分析，结合收益率、信用风险评价、利率风险以及交易所流动性的分析，判断个券的投资价值，以挑选估值差异匹配的券种，建立具体的个券组合。

（6）杠杆投资策略

本基金将在考虑债券信用风险、流动性风险，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过融资操作，放大杠杆进行投资管理。

（7）资产支持证券的投资策略

1. 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的基础上，对资产证券化产品的收益和风险匹配情况等进行定性和定量的全面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能地提高组合的收益率。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（8）中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券普遍具有高风险和高收益的特征特点。本基金将对个券信用资质进行详尽的分析，着重分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。

2. 开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性需求。

（二）基金的投资管理流程

1. 决策依据

（1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；

（2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；

（3）国内宏观经济