

中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）

摘要

基金管理人：中加基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会 2014 年 1 月 29 日证监许可[2014]181 号文准予募集注册，本基金基金合同于 2014 年 3 月 24 日正式生效。

基金管理人保证本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，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（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导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债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。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。

本基金的投资范围包括国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、非政策性金融债、企业债（含中小企业私募债）、公司债、短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，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。

本基金可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

本基金基金份额初始面值 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

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它基金的业绩并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。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 3 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 12 月 31 日。（财务数据未经审计）

一、基金管理人（一）基金管理人概况

名称：中加基金管理有限公司

注册地址：北京市顺义区仁和镇顺泽大街 65 号 317 室

办公地址：北京市西城区南纬路 35 号

法定代表人：闫冰竹

成立时间：2013 年 3 月 27 日

电话：010-63620212

联系人：李佳

注册资本：3 亿元人民币

股权结构：

中加基金管理有限公司是经中国证监会证监许可字【2013】247 号文批准，由北京银行股份有限公司、加拿大丰业银行、北京有色金属研究总院共同发起设立，注册资本为 3 亿元人民币。目前的股权比例为：北京银行股份有限公司 62%、加拿大丰业银行 33%、北京有色金属研究总院 5%。

基金管理情况：目前基金管理人旗下管理六只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债分级债券型证券投资基金（A/B）、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心安灵活配置混合型证券投资基金、中加心安保本混合型证券投资基金。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

闫冰竹先生，董事长，管理学硕士。自 1975 年起，闫先生历任中国人民银行、中国工商银行北京分理处主任、营业部总经理、分行总稽核等职务，1996 年参与组建北京银行并出任首任行长，2002 年至今担任北京银行党委书记、董事长。闫先生为中共第十七次全国代表大会代表，第十一届、十二届全国政协委员，全国政协经济委员会副主任，中共第十届北京市委委员，中国企业家协会副会长，中国银行业协会副会长，中国金融学会常务理事，享受国务院特殊津贴专家。

2013 年 3 月起兼任中加基金管理有限公司董事长。

杨书剑先生，董事，经济学博士。1997 年加入北京银行，历任总行银行卡业务主管、总行办公室副主任、总行人事部副总经理、学院路支行行长、总行董事会办公室副主任、主任、董事会秘书等职务；现任北京银行执行董事、副行长、董事会秘书。长期负责北京银行综合经营和投资管理方面业务，熟悉资本市场和资本运作。

冯丽华女士，董事，管理学硕士。自 1985 年始，冯女士历任工商银行东城支行计划科副科长、北京市计委财政金融处正科级调研员、北京银行资金计划部、公司金融部、个人银行部、财富管理部等部门总经理。现任北京银行股份有限公司零售业务总监。

苏利文先生（James O' Sullivan），2014 年 12 月加入公司董事会，拥有约克大学数学系的专业荣誉文学士学位、奥斯古德法学院法学博士学位以及约克大学舒力克商学院的工商管理硕士学位。苏利文先生还曾任多伦多亨伯河医院董事会主席。1990 年加入加拿大丰业银行，并在投资银行业务及并购部担任高级领导职务；自 2014 年 11 月起，苏利文先生被任命为全球财富管理执行副总裁，负责全球零售和机构资产管理及财富管理业务。

周美思女士，毕业于香港理工大学，拥有加拿大财务策划协会和财务策划师标准理事会颁发的财务策划证书，同时也是加拿大银行家协会院士。周女士拥有 25 年金融市场工作经验，擅长于国际商务管理，合资经营，基金及经纪业务。在她丰富的职业生涯中，推出了领先的区域和国际投资基金，建立过基金超市，并在日本建立第一只美元清算基金，也曾在香港、新加坡和日本等跨国金融机构担任领导职务。目前，周女士任职加拿大丰业银行亚太区财富管理业务副总裁，负责亚太地区全面财富管理策略的开发和执行，领导亚洲财富管理业务，包括理念构思与设计，市场评估，产品开发管理以及财务，经营合规性和风险管理。

张少明先生，董事，工学博士。自 1984 年始，张先生先后在北京有色金属研究总院（以下简称“有研总院”）208 室、复合材料研究中心、开发经营处、投资

经营部等部门担任副主任、常务副主任、处长、主任等职务，2001年起担任有研总院副院长，2006年起担任有研总院党委书记、副院长，2009年起任有研总院院长至今。

杨运杰先生，独立董事，经济学博士、教授、博士生导师。自1986年始，杨先生先后在河北林学院、中央财经大学担任经济学的教学工作，并先后担任系副主任、研究生部常务副主任、学院院长等职务，期间还在深圳经济特区证券公司北京管理总部担任研发部经理。现任中央财经大学经济学院院长、教授、博士生导师。

吴小英女士，独立董事，研究生。自1985年起，吴女士先后在中国人民银行廊坊分行人事科、中国银行中苑宾馆、中国民族国际信托投资公司、中国民族证券有限责任公司工作，并先后担任副科长、人事主管、商贸部总经理、纪委副书记等职务。

杨戈先生，独立董事，工商管理硕士。自1993年始，杨先生先后在中国航空技术进出口总公司担任分析员、在法国里昂证券亚洲有限公司担任经理、在WI Harper Group（中经合集团）担任经理、在中华创业网担任总经理、在鑫苏创业投资公司担任合伙人、在北京华创先锋科技有限公司担任总经理并在美国纽约证券交易所北京代表处担任首席代表等职务。

2、监事会成员

高红女士，监事。现任北京银行股份有限公司北京管理部公司银行部总经理。高女士自1994年起，先后担任湖北国际信托投资公司营业部总经理、湖北三峡证券有限责任公司恒惠营业部总经理、黑龙江佳木斯证券公司总经理、北京证券有限责任公司经纪业务总监、西北证券有限公司董事长助理兼合规部总经理等职务，拥有丰富的金融行业工作和管理经验。2008年加入北京银行，先后任职于总行公司银行总部、北京管理部大企业客户二部及公司银行部。

秦浩腾先生（Jordy Chilcott），监事。注册财务规划师，丰业银行全球资产管理零售业务主管，负责大明互惠基金，丰业基金产品和分布在19个国家的国际基金业务，同时也负责通过银行的全球分销渠道及加拿大的独立理财顾问师的庞大网络进行基金的销售工作。秦浩腾先生在金融服务行业的职业生涯超过27年，涉及咨询管理，销售和基金研发等多个领域。秦浩腾先生于2006年加入大明互惠基金，2010年大明互惠基金被丰业银行收购之后，秦浩腾先生开始负责加拿大丰业银行的国内基金和国际资产管理业务。秦浩腾先生在加入大明互惠基金之前，曾担任标准人寿基金的高级副总裁。秦浩腾先生积极参与许多行业组织，包括加拿大投资基金协会（IFIC）特设战略研究委员会和公众联络委员会，以及加拿大

丰业银行内部附属的众多指导委员会。

刘向途先生，职工监事，经济学硕士。曾任北京银行董事会办公室证券事务组负责人、投资者关系室经理，全程参与北京银行 IPO 及再融资，日常主要从事北京银行证券事务、投资者关系管理、投融资管理等工作，期间还从事过北京银行公司治理工作，熟悉资本市场、股权投资管理及公司治理等相关业务；2013 年 5 月加入中加基金管理有限公司，任投资研究部副总监。

王雯雯女士，职工监事，经济学硕士。曾任职于北京银行，从事风险管理等相关业务；2013 年 5 月加入中加基金管理有限公司，任监察稽核经理。

3、总经理及其他高级管理人员

闫冰竹先生，董事长，管理学硕士。自 1975 年起，闫先生历任中国人民银行、中国工商银行北京分理处主任、营业部总经理、分行总稽核等职务，1996 年参与组建北京银行并出任首任行长，2002 年至今担任北京银行党委书记、董事长。闫先生为中共第十七次全国代表大会代表，第十一届、十二届全国政协委员，全国政协经济委员会副主任，中共第十届北京市委委员，中国企业家协会副会长，中国银行业协会副会长，中国金融学会常务理事，享受国务院特殊津贴专家。

2013 年 3 月起兼任中加基金管理有限公司董事长。

夏英先生，总经理，金融硕士学位，于 1996 年加入北京银行，历任总行办公室副主任、支行行长、资金交易部副总经理，具有丰富的金融业工作经验。现任中加基金管理公司总经理、投资决策委员会主席、产品开发委员会主席。

魏忠先生（John Zhong Wei），副总经理，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理经理（FRM）、加拿大投资经理（CIM）；曾任职于富兰克林谭普顿投资公司（多伦多，加拿大），大明基金（Dynamic Funds，多伦多，加拿大）及丰业银行全球资产管理（多伦多，加拿大）；自 2014 年 3 月担任公司副总经理，并主管风险管理业务。

霍向辉先生，督察长，国际金融专业学士学位，1998 年加入北京银行，先后在支行、总行信贷管理部任职，后担任支行行长，2012 年起担任北京银行南宁工作室负责人，负责分行筹建工作。2013 年 3 月加入中加基金管理有限公司，任督察长。

4、基金经理

闫沛贤，英国帝国理工大学金融学及伯明翰大学计算机双硕士。历任英国国家航空公司软件工程师，平安银行资金交易部交易员，北京银行资金交易部交易员，负责债券市场和货币市场的投资交易工作和银行流动性管理。2012 年荣获“银行间债券市场优秀交易员”荣誉称号。2013 年加入中加基金管理有限公司，

2014年3月24日至今担任本基金基金经理；闫沛贤先生自2013年10月至今还担任中加货币市场基金基金经理，自2014年12月17日至今同时担任中加纯债分级债券型证券投资基金基金经理，自2015年12月28日至今同时担任中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会

投资决策委员会成员包括公司总经理夏英先生，投资研究副总监刘向途先生，市场营销部副总监希琳女士，基金经理闫沛贤先生、张旭先生、杨宇俊先生，专户投资经理李继民先生、赵军华先生，投资研究部研究员廉晓婵女士。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

- 1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。
- 2、本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。
- 3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不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) 从事使基金承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、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。

4、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 其它法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取利益。
- (2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密以及尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，不利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。
- (4) 不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

- (1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；
- (2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，

并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部门和监察稽核部门，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

（3）审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（4）有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（5）及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

（6）适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

（7）定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性；

（8）成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

（9）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

2、内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

（1）公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

（2）公司基本管理制度包括风险管理制度、监察稽核制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。

（3）部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定。

3、完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系，董事会层面设立督察长，管理层设立独立于其他业务部门的监察稽核部门和风险管理部门，通过风险管理制度和监察稽核制度两个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系，对公司内部控制和 risk 管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈，保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理方面由董事会下设的风险管理委员会制定风险管理政策，由管理层的风险控制委员会负责实施，由风险管理部门专职落实和监督，公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施，全面把握风险点，将风险管理责任落实到人，实现对风险的日常管理和过程中管理，防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

监察稽核制度在督察长的领导下严格实施，由监察稽核部门协助和配合督察长履行稽核监察职能。通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估，监督公司及员工遵守国家相关法律法规、监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况，识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险，提出并完善公司各项合规性制度，以充分维护公司客户的合法权益。通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

4、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和 risk 管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善 risk 管理和内部控制制度。

二、基金托管人（一）基金托管人的基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

法定代表人：李国华

成立时间：2007 年 3 月 6 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：570 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673 号

联系人：王瑛

联系电话：010—68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；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；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于 2007 年 3 月 6 日）于 2012 年 1 月 21 日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

（二）主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工 20 人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

（三）基金托管业务经营情况

2009 年 7 月 23 日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第 16 家托管银行。2012 年 7 月 19 日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2015 年 12 月 31 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 44 只，包括

中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF) (原中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)) (166006)、长信纯债壹号债券型证券投资基金(原长信短债证券投资基金)(519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金(400013)、万家添利债券型证券投资基金(LOF) (161908)、长信利鑫分级债券型证券投资基金(163003)、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF) (164208)、鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF) (160618)、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金(400015)、长安宏观策略股票型证券投资基金(740001)、金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF) (162105)、中欧信用增利债券型证券投资基金(LOF) (166012)、农银汇理消费主题股票型证券投资基金(660012)、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金(519117)、天弘现金管家货币市场基金(420006)、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金(540012)、华安安心收益债券型证券投资基金(040036)、东方强化收益债券型证券投资基金(400016)、中欧纯债分级债券型证券投资基金(166016)、东方安心收益保本混合型证券投资基金(400020)、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金(519662)、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金(166021)、银河灵活配置混合型证券投资基金(519656)、天弘通利混合型证券投资基金(000573)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金(000552)、南方通利债券型证券投资基金(000563)、中邮货币市场基金(000576)、易方达财富快线货币市场基金(000647)、天弘瑞利分级债券型证券投资基金(000774)、中邮核心科技创新灵活配置混合证券投资基金(000966)、中信建投凤凰货币市场基金(001006)、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金(001194)、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金(001183)、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金(001216)、易方达改革红利混合型证券投资基金(001076)、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金(001250)、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金(001249)、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金(001285)、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金(001210)、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金(001447)、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金(001314)、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金(001431)、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金(001433)、南方利安灵活配置混合型证券投资基金(001570)、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金(002107)。至今,中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品(本外币)、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系,托管规模达22,508.33亿元。

（四）基金托管人的内部风险控制制度。

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制处室，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（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

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，对违法违规行为及时予以风险提示，要求其限期纠正，同时报告中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1) 每个工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构（一）基金份额发售机构

1、直销中心

名称：中加基金管理有限公司

注册地址：北京市顺义区仁和镇顺泽大街 65 号 317 室

办公地址：北京市西城区南纬路 35 号

法定代表人：闫冰竹

全国统一客户服务电话：400-00-95526

传真：010-83197627

联系人：王悦

公司网站：www.bobbns.com

2、其他销售机构

（1）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

（2）中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

网址：www.psbc.com

（3）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：962528（北京、上海）、96528

网址：www.nbcb.com.cn

（4）杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市下城区庆春路 46 号

办公地址：杭州市下城区庆春路 46 号

法定代表人：吴太普

客户服务电话：400-8888-508、96523（浙江）

网址：www.hzbank.com.cn

（5）上海农商银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15—20，22—27 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15—20，22—27 层

法定代表人：胡平西

客户服务电话：4006-962999、021-962999

网址：www.srcb.com

（6）南京银行股份有限公司

注册地址：南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：南京市中山路 288 号

法定代表人：林复

客户服务电话：40088-96400、96400（江苏）

网址：www.njcb.com.cn

（7）河北银行股份有限公司

注册地址：石家庄市平安北大街 28 号

办公地址：石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：乔志强

客户服务电话：400-612-9999

网址：www.hebbank.com

（8）天津银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区友谊路 15 号

办公地址：天津市河西区友谊路 15 号

法定代表人：王金龙

客户服务电话：4006-960296

网址：www.bank-of-tianjin.com

（9）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话： 4008-888-108

网址： www.csc108.com

(10) 中信证券股份有限公司

注册地址： 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址： 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人： 王东明

客户服务电话： 95548

网址： www.cs.ecitic.com

(11) 中信万通证券有限责任公司

注册地址： 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址： 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人： 杨宝林

客户服务电话： 95548

网址： www.zxwt.com.cn

(12) 江苏银行股份有限公司

注册地址： 江苏省南京市洪武北路 55 号

办公地址： 江苏省南京市洪武北路 55 号

法定代表人： 夏平

客户服务电话： 40086-96098

网址： www.jsbchina.cn

(13) 徽商银行股份有限公司

注册地址： 合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

办公地址： 合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人： 李宏鸣

客户服务电话： 40088-96588、96588(安徽)

网址： www.hsbank.com.cn

(14) 中国光大银行股份有限公司

注册地址： 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址： 北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人： 唐双宁

电话： 010-63636153

传真： 010-63639709

客户服务电话： 95595

网址: www.cebbank.com

(15) 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 195 号 3C 座 9 层

法定代表人: 其实

客服电话: 400-1818-188

网址: www.1234567.com.cn

(16) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址: 浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座

法定代表人: 陈柏青

客服电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

(17) 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市银城中路 188 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

客服电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(18) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人: 闫振杰

客户服务电话: 400 818 8000

网址: <http://www.myfund.com/>

(19) 招商证券股份有限公司

注册地址: 中国深圳福田区益田路江苏大厦 38-45 层楼

办公地址: 中国深圳福田区益田路江苏大厦 38-45 层楼

法定代表人: 宫少林

客户服务电话: 95565

网址: www.newone.com.cn/

(20) 中国国际期货有限责任公司

注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、

12 层

办公地址：北京市朝阳区光华路 14 号中期大厦 A 座 9 层

法定代表人：王兵

客户服务电话：95162 或 400—888—8160

网站：<http://www.cifco.net/>

(21) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(22) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn 或 www.jjmmw.com

(23) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：沈伟桦

客服电话：400-609-9200

网址：www.yixinfund.com

(24) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008773772

网址：www.5ifund.com

(25) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：95551 或 40088-88888

网址：<http://www.chinastock.com.cn/>

(26) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：黄扬录

客户服务电话：4001-022-011

网址：www.zszq.com.cn

(27) 中信建投期货有限公司

注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、

C

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、

C

法定代表人：彭文德

电话：023-86769605

客户服务电话：400-8877-780

网址：www.cfc108.com

(28) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

(29) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：广东省惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

网址：<http://www.lxzq.com.cn/>

(30) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客户服务电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn>

(31) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811

网址：<http://www.zcvc.com.cn/>

(32) 广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号信合大厦

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号信合大厦

法定代表人：王继康

客户服务电话：95313

网址：<http://www.grcbank.com>

(33) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：95553/400-888-8001

网址：<http://www.htsec.com/htsec.html>

(34) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301 室-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301 室-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-990-8826

网址：<http://www.citicsf.com/>

(35) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室

办公地址：北京市海淀区海淀北二街 10 号泰鹏大厦 12 层

法定代表人：张琪

客户服务电话：010-62675369

网址：<http://www.xincai.com/>

(36) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人：金佶

客户服务电话：4008202819

网址：<https://www.chinapnr.com/>

(37) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：[https:// www.noah-fund.com](https://www.noah-fund.com)

(38) 上海陆金所资管资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼

法定代表人：鲍东华

客户服务电话：4008219031

网址：[https:// www.lufunds.com](https://www.lufunds.com)

其他销售机构详见基金份额发售公告

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并按照相关规定

及时公告。

(二) 登记机构

名称：中加基金管理有限公司

注册地址：北京市顺义区仁和镇顺泽大街 65 号 317 室

办公地址：北京市西城区南纬路 35 号

法定代表人：闫冰竹

全国统一客户服务电话：400-00-95526

传真：010-66226080

联系人：李佳

（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：俞卫峰

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（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：中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

法定代表人：邹俊

经办注册会计师：李砾

电话：010-8508 7929

传真：010-8518 5111

联系人：管祎铭

四、基金的名称本基金名称：中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向本基金的投资范围包括国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、非政策性金融债、企业债（含中小企业私募债）、公司债、短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的规定）。

本基金可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

八、基金的投资策略本基金的主要投资策略包括：期限配置策略、期限结构策略、类属配置策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中的投资策略及资产支持证券等品种投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。

1、期限配置策略

为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在每个封闭期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金剩余封闭期限进行适当的匹配。

2、期限结构策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。

在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略，包括：子弹型策略、哑铃型策略、梯形策略等。

3、类属配置策略

对于债券资产而言，是信用债、政策性金融债和国债之间的比例配置。当宏观经济转向衰退周期，企业信用风险将普遍提高，此时降低信用债投资比例，降低幅度应该结合利差预期上升幅度和持有期收益分析结果来进行确定。相反，当宏观经济转向复苏，企业信用风险普遍下降，此时应该提高信用债投资比例，提高幅度应该结合利差预期下降幅度和持有期收益分析结果来进行确定。此外，还将考察一些特殊因素对于信用债配置产生影响，其中包括供给的节奏，主要投资主体的投资习惯，以及替代资产的冲击等均对信用利差产生影响，因此，在中国市场分析信用债投资机会，不仅需要分析信用风险趋势，还需要分析供需面和替代资产的冲击等因素，最后，在预期的利差变动范围内，进行持有期收益分析，以确定最佳的信用债投资比例和最佳的信用债持有结构。

4、证券选择策略

根据发行人公司所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息对债券发行人主体进行评级，在此基础上，进一步结合债券发行具体条款（主要是债券担保状况）对债券进行评级。根据信用债的评级，给予相应的信用风险溢价，与市场上的信用利差进行对比，发掘具备相对价值的个券。

5、短期和中长期的市场环境中的投资策略

在一般情况下，本基金坚持中长期投资理念，对于投资组合中的债券进行中长期投资。但是，由于市场的波动，亦会导致证券的价格在短期内偏离其合理价值区间，在此种情况下，本基金可能进行短期波段性操作，具体表现在以下几个方面：

1) 所买入的证券在短期内出现价格急剧波动，严重高出其合理价值区间，本基金将全部或者部分卖出该证券，以实现投资收益，而市场价格经过自身内在机制调整，重新回到合理价值区间时再重新买入。

2) 由于市场出现未能预见的不利变化，导致前期投资决策的基础条件不复存在，此时，为有效控制投资组合风险，本基金亦将进行短期操作。

6、资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

九、基金的业绩比较基准本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率+1.3%。

本基金选择一年期银行定期存款收益率+1.3%作为业绩比较基准的原因如下：

本基金是定期开放式债券型基金，封闭期为一年。为满足开放期的流动性需求，本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。以一年期银行定期存款税后收益率上浮 1.3%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整前 2 个工作日在指定媒体上予以公告。

十、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的较低风险

品种，其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十一、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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月18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自2015年10月01日起至2015年12月31日止，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

金额单位：人民币元

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 1,679,268,523.00 93.78

其中：债券 1,679,268,523.00 93.78

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 — —

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 35,294,614.22 1.97

8 其他资产 76,008,516.75 4.24

9 合计 1,790,571,653.97 100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	230,223.00	0.02
其中：政策性金融债 230,223.00 0.02			
4	企业债券	625,655,800.00	61.63
5	企业短期融资券	276,981,500.00	27.28
6	中期票据	776,401,000.00	76.48
7	可转债	—	—
8	同业存单		
9	其他	—	—
10	合计	1,679,268,523.00	165.41

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。

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

金额单位：人民币元

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	011599456	15 奇瑞 SCP003	750,000	75,532,500.00	7.44
2	122367	14 财富债	700,000	73,892,000.00	7.28
3	101469004	14 湘经开 MTN002	500,000	56,205,000.00	5.54
4	101552032	15 晋焦煤 MTN004	550,000	55,825,000.00	5.50
5	112203	14 北农债	500,000	54,540,000.00	5.37

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. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

11. 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名债券的发行主体本期末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。

11.2 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。

11.3 期末各项资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 8,609.88

2 应收证券清算款 36,928,642.26

3 应收股利 —

4 应收利息 39,071,264.61

5 应收申购款 —

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 76,008,516.75

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 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。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

十二、基金的业绩 1、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

中加纯债一年 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

过去三个月 3.49% 0.11% 0.73% 0.01% 2.76% 0.10%

中加纯债一年 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

过去三个月 3.43% 0.10% 0.73% 0.01% 2.70% 0.09%

2、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

本基金 A 类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

本基金 C 类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

注：本基金基金合同于 2014 年 3 月 24 日生效。根据基金合同的约定，本基金建仓期为 3 个月，建仓期结束时，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、基金的销售服务费；

- 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、基金的开户费用；
- 10、基金的登记结算费用；
- 11、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 0.68% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.68\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 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、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 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 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 0.19% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.19\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。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 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 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

0.38%。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。销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.38%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.38\% \div \text{当年天数}$

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

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提，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销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人按照相关合同约定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至支付法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

上述“（一）基金费用的种类中第4—11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）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2个工作日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明依据《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》、《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》及其他有关法律法规的要求，我公司结合中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金的运行情况，对其原招募说明书进行了更新，主要更新的内容说明如下：

一、更新了“三、基金管理人”的相关信息；

二、更新了“四、基金托管人”的相关信息；

三、更新了“五、相关服务机构”的相关信息；

四、在“十、基金的投资”中根据本基金的实际运作情况，更新了最近一期投资组合报告的内容，及最近一期基金业绩和同期业绩比较基准的表现。

五、在“二十二、其他应披露事项”中披露了本期已刊登的公告内容。

上述内容仅为摘要，须与本基金《招募说明书》正文所载之详细资料一并阅读。