

# 广发集丰债券型证券投资基金 更新的招募说明书摘要

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

时间：二〇一八年十二月

## 【重要提示】

本基金于 2016 年 4 月 6 日经中国证监会证监许可[2016]671 文准予注册。

本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。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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，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。

本基金可投资中小企业私募债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，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。本基金需承担债券市场的系统性风险，以及因个别债券违约所形成的信用风险，因此信用风险对基金份额净值影响较大。

本基金基金份额分为 A、C 类，A 类基金份额收取认（申）购费，C 类基金份额不收取认（申）购费，但计提销售服务费；A、C 类基金份额适用不同的赎回费率。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2018 年 11 月 1 日，有关财务数据截止日为 2018 年 9 月 30 日、净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、概况

- 1、名称：广发基金管理有限公司
- 2、住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）
- 3、办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
- 4、法定代表人：孙树明
- 5、设立时间：2003年8月5日
- 6、电话：020-83936666  
全国统一客服热线：95105828
- 7、联系人：邱春杨
- 8、注册资本：1.2688亿元人民币
- 9、股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

孙树明先生：董事长，博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长，中国证券业协会第六届理事会兼职副会长，上海证券交易所第四届理事会理事，深圳证券交易所第二届监事会监事，中国上市公司协会第二届理事会兼职副会长，亚洲金融合作协会理事，中国注册会计师协会道德准则委员会委员，广东金融学会副会长，广东省预防腐败工作专家咨询委员会财政金融运行规范组成员。曾任财政部条法司副处长、处长，中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，中国银河证券有限公司监事会监事，中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传辉先生：副董事长，学士，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会

委员、资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

孙晓燕女士：董事，硕士，现任广发证券执行董事、副总经理、财务总监，兼任广发控股（香港）有限公司董事，证通股份有限公司监事长。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、广发证券股份有限公司投资自营部副总经理，广发基金管理有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司财务部总经理。

戈俊先生：董事，硕士，高级会计师，现任烽火通信科技股份有限公司总裁，兼任南京烽火星空通信发展有限公司董事。曾任烽火通信科技股份有限公司财务部总经理助理、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

翟美卿女士：董事，硕士，现任深圳香江控股股份有限公司董事长，南方香江集团董事长、总经理，香江集团有限公司总裁、深圳市金海马实业股份有限公司董事长。兼任全国政协委员，全国妇联常委，中国女企业家协会副会长，广东省妇联副主席，广东省工商联副主席，广东省女企业家协会会长，香江社会救助基金会主席，深圳市深商控股集团股份有限公司董事，广东南粤银行董事，深圳龙岗国安村镇银行董事。曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人、董事长。

许冬瑾女士：董事，硕士，副主任药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、常务副总经理，兼任世界中联中药饮片质量专业委员会副会长、国家中医药管理局对外交流合作专家咨询委员会委员、中国中药协会中药饮片专业委员会专家，全国中药标准化技术委员会委员，全国制药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员，国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工专业专家委员会副主任委员，广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。

罗海平先生：独立董事，博士，现任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理、集团机关党委书记，兼任保监会行业风险评估专家。曾任中国人民保险公司荆襄支公司经理、湖北省分公司国际保险部党组书记、总经理、汉口分公司党委书记、总经理，太平保险有限公司市场部总经理、湖北分公司党委书记、总经理、助理总经理、副总经理兼董事会秘书，阳光财产保险股份有限公司总裁，阳光保险集团执行委员会委员，中华联合财产保险股份有限公司总经理、董事长、党委书记。

董茂云先生：独立董事，博士，现任宁波大学法学院教授、学术委员会主任，复旦大学兼职教授，浙江合创律师事务所兼职律师。曾任复旦大学教授、法律系副主任、法学院副院长，海尔施生物医药股份有限公司独立董事。

姚海鑫先生：独立董事，博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学新华国际商学院教授、辽宁大学商学院博士生导师，兼任中国会计教授会理事、东北地区高校财务与会计教师联合会常务理事、辽宁省生产力学会副理事长、东北制药（集团）股份有限公司独立董事、沈阳化工股份有限公司独立董事和中兴-沈阳商业大厦（集团）股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记、新华国际商学院副院长。

## 2、监事会成员

符兵先生：监事会主席，硕士，经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长，广东发展银行广州分行世贸支行行长、总行资金部处长，广发基金管理有限公司广州分公司总经理、市场拓展部副总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡丽军女士：股东监事，硕士，高级涉外秘书，现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任，广州屈臣氏公司行政主管，广州市科达实业发展公司办公室主任、总经理，广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉先生：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理，兼任广发基金分工会主席。曾任广发证券电脑中心副经理、经理。

张成柱先生：职工监事，学士，现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师，广发证券股份有限公司工程师，广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘敏女士：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理，营销服务部总经理助理，产品营销管理部总经理助理。

## 3、总经理及其他高级管理人员

林传辉先生：总经理，学士，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，

深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

朱平先生：副总经理，硕士，经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理，易方达基金管理有限公司投资部研究负责人，广发基金管理有限公司总经理助理，中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。

易阳方先生：副总经理，硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理、公司总经理助理，广发聚富开放式证券投资基金基金经理、广发制造业精选混合型证券投资基金基金经理、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理、广发聚丰混合型证券投资基金基金经理、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，瑞元资本管理有限公司董事。

邱春杨先生：督察长，博士。曾任广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、产品总监、副总经理，广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理、广发中证 500 指数证券投资基金基金经理，瑞元资本管理有限公司董事。

魏恒江先生：副总经理，硕士，高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士：副总经理，硕士，兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国农业科学院助理研究员，中国证监会培训中心、监察局科员，基金监管部副处长及处长，私募基金监管部处长。

张芊女士：副总经理，硕士。兼任广发基金管理有限公司固定收益投资总监、广发纯债债券型证券投资基金基金经理、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发集裕债券型证券投资基金基金经理、广发集丰债券型证券投资基金基金经理、广发集源债券型证券投资基金基金经理。曾在施耐德电气公司、中国银河证券、中国人保资产管理公司、工银瑞信基金管理有限公司

司和长盛基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司固定收益部总经理，广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发集安债券型证券投资基金基金经理。

王凡先生：副总经理，博士。曾在财政部、全国社保基金理事会、易方达基金管理有限公司工作。

#### 4、基金经理

张芊女士，经济学和工商管理双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国银河证券研究中心研究员，中国人保资产管理有限公司高级研究员、投资主管，工银瑞信基金管理有限公司研究员，长盛基金管理有限公司投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部总经理、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 11 月 23 日至 2016 年 12 月 8 日）、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 30 日至 2017 年 2 月 6 日）、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 29 日至 2018 年 1 月 6 日）、广发集安债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 20 日至 2018 年 10 月 9 日）。现任广发基金管理有限公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理、广发纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2012 年 12 月 14 日起任职）、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 7 月 12 日起任职）、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 25 日起任职）、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 3 月 1 日起任职）、广发集裕债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 11 日起任职）、广发集丰债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 1 日起任职）、广发集源债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 20 日起任职）。

代宇女士，金融学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 6 月 5 日至 2015 年 7 月 23 日）、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 12 月 13 日至 2018 年 1 月 11 日）、广发安心回报混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 5 月 14 日至 2018 年 1 月 12 日）、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 4 月 15 日至 2018 年 3 月 14 日）、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 28 日至 2018 年 6 月 12 日）、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 2 月 8 日至 2018 年 10 月 30 日）、广发量化稳健混合型证券投资

资基金基金经理（自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日）。现任广发基金管理有限公司债券投资部副总经理、广发聚利债券型证券投资基金基金经理（自 2011 年 8 月 5 日起任职）、广发聚财信用债券型证券投资基金基金经理（自 2012 年 3 月 13 日起任职）、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 8 月 21 日起任职）、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 2 月 17 日起任职）、广发安泰回报混合型证券投资基金（自 2015 年 5 月 14 日起任职）、广发双债添利债券型证券投资基金基金经理（自 2015 年 5 月 27 日起任职）、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 7 月 26 日起任职）、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 19 日起任职）、广发集丰债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 9 日起任职）、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 6 日起任职）、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 2 月 13 日起任职）、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 3 月 31 日起任职）、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 6 月 27 日起任职）、广发上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金（自 2018 年 3 月 26 日起任职）、广发汇瑞 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 6 月 13 日起任职）、广发汇誉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（自 2018 年 6 月 20 日起任职）、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 10 月 30 日起任职）。

5、基金投资采取集体决策制度。基金管理人权益公募投委会由副总经理朱平先生、策略投资部总经理李巍先生、价值投资部总经理傅友兴先生、成长投资部总经理刘格菘先生和研究发展部总经理孙迪先生等成员组成，朱平先生担任投委会主席。基金管理人固定收益投委会由副总经理张芊女士、债券投资部总经理谢军先生、现金投资部总经理温秀娟女士、债券投资部副总经理代宇女士和固定收益研究部副总经理韩晟先生等成员组成，张芊女士担任投委会主席。

6、上述人员之间均不存在亲属关系。



## 第二部分 基金托管人

### 一、 基金托管人基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

成立时间：2004 年 9 月 17 日

法定代表人：田国立

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系电话：(010)6759 5096

联系人：田 青

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年 6 月末，本集团资产总额 228,051.82 亿元，较上年末增加 6,807.99 亿元，增幅 3.08%。上半年，本集团盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加 93.27 亿元至 1,814.20 亿元，增幅 5.42%；净利润较上年同期增加 84.56 亿元至 1,474.65 亿元，增幅 6.08%。

2017 年，本集团先后荣获香港《亚洲货币》“2017 年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017 最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017 年中国最佳数字银行”、“2017 年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017 最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在英国《银行家》“2017 全球银行 1000 强”中列第 2 位；在美国《财富》“2017 年世界 500 强排行榜”中列第 28 名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境

托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 315 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 二、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 三、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2018 年二季度末，中国建设银行已托管 857 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、

4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务：

##### (1) 广州分公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔10楼

直销中心电话：020-89899073

传真：020-89899069 020-89899070

##### (2) 北京分公司

地址：北京市西城区金融大街9号楼11层1101单元

(电梯楼层12层1201单元)

电话：010-68083113

传真：010-68083078

##### (3) 上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路166号905-10室

电话：021-68885310

传真：021-68885200

##### (4) 网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

本公司网址：[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)

客服电话：95105828（免长途费）或 020-83936999

客服传真：020-34281105

(5) 投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

#### 2、其他销售机构

本基金发售期间，若新增销售机构或销售机构新增营业网点，则另行公告。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## 二、注册登记机构

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31—33楼

法定代表人：孙树明

联系人：李尔华

电话：020-89898970

传真：020-89899175

## 三、律师事务所和经办律师

名称：广东广信君达律师事务所

住所：广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州周大福金融中心29层、10层

负责人：王晓华

电话：020-37181333

传真：020-37181388

经办律师：王晓华

联系人：刘智、杨琳

## 四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法人代表：毛鞍宁

联系人：赵雅

电话：020-28812888

传真：020-28812618

经办注册会计师：赵雅、李明明

#### 第四部分 基金的名称

广发集丰债券型证券投资基金

#### 第五部分 基金类型

债券型证券投资基金

#### 第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。

#### 第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围主要为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、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债、分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、大额可转让存单和货币市场工具等固定收益类金融工具，国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货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的相关规定）。

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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券类资产比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## 第八部分 基金的投资策略

### （一）大类资产配置策略

本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。

### （二）债券投资策略

本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。

#### 1、利率预期策略与久期管理

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。

#### 2、类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

#### 3、信用债券投资策略

本基金将重点投资于企业债、公司债、金融债、地方政府债、短期融资券、中期票据、分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券等信用债券，以提高组合的收益水平。

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面对收益率曲线的判断以及对信用债整体信用利差研究的基础上，确定信用债总体的投资比例。考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，本基金还将

以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。本基金的信用债投资策略主要包括信用利差曲线配置、信用债供求分析策略、信用债券精选和信用债调整等四个方面。

#### 4、可转债投资策略

可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深度挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

#### 5、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

#### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 7、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

### （三）股票投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资，以增加基金收益。

本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散



化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

投资方法上重视投资价值与成长潜力的平衡，一方面利用价值投资标准筛选低价股票，避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险；另一方面，利用成长性投资可分享高成长收益的机会。

#### （四）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金可以主动投资于权证，其投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素，对权证进行定价。

### 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债总全价指数收益率。

中债总全价指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体收益情况。

采用该比较基准主要基于如下考虑：

1、中债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；

2、在中债指数体系中，中债总全价指数所代表的债券市场的风险收益特征与本基金较为贴近。因此，中债总全价指数比较适合作为本基金的比较基准。

如果中央国债登记结算有限责任公司停止计算编制该指数或更改指数名称，经与基金托管人协商一致，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。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人可以根据具体情况，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致且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，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

## 第十一部分 基金的投资组合报告

广发基金管理有限公司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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年12月12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截至2018年9月30日，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

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	固定收益投资	105,648,600.00	93.08
	其中：债券	105,648,600.00	93.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	6,043,492.22	5.32
7	其他资产	1,812,916.54	1.60
8	合计	113,505,008.76	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 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

序号	债券品种	公允价值（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	11,021,100.00	9.75
	其中：政策性金融债	11,021,100.00	9.75
4	企业债券	54,074,500.00	47.81
5	企业短期融资券	10,053,000.00	8.89
6	中期票据	30,500,000.00	26.97
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	105,648,600.00	93.42

#### 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	143201	17 南山 01	200,000	19,988,000.00	17.67
2	1180007	11 渝城投债	100,000	10,362,000.00	9.16
3	101353010	13 中煤 MTN002	100,000	10,238,000.00	9.05
4	101562013	15 阳泉 MTN001	100,000	10,218,000.00	9.04
5	011800682	18 晋能 SCP005	100,000	10,053,000.00	8.89

#### 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

本基金本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

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 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在本报告期内没有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) 报告期内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。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,542.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,789,363.90
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,812,916.54

### (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。

### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 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、勤勉尽责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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 6 月 30 日。

### 1、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

广发集丰债券 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	-0.20%	0.06%	-2.76%	0.23%	2.56%	-0.17%
2017 年	5.50%	0.15%	-4.26%	0.09%	9.76%	0.06%
2018.1.1 — 2018.6.30	-0.79%	0.22%	2.99%	0.12%	-3.78%	0.10%
基金合同生效至今	4.46%	0.17%	-4.12%	0.12%	8.58%	0.05%

广发集丰债券 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	-0.30%	0.05%	-2.76%	0.23%	2.46%	-0.18%
2017 年	5.20%	0.15%	-4.26%	0.09%	9.46%	0.06%
2018.1.1 —	-0.69%	0.21%	2.99%	0.12%	-3.68%	0.09%

2018.6.30						
基金合同生效至今	4.16%	0.16%	-4.12%	0.12%	8.28%	0.04%

注：本基金业绩比较基准：中债总全价指数。

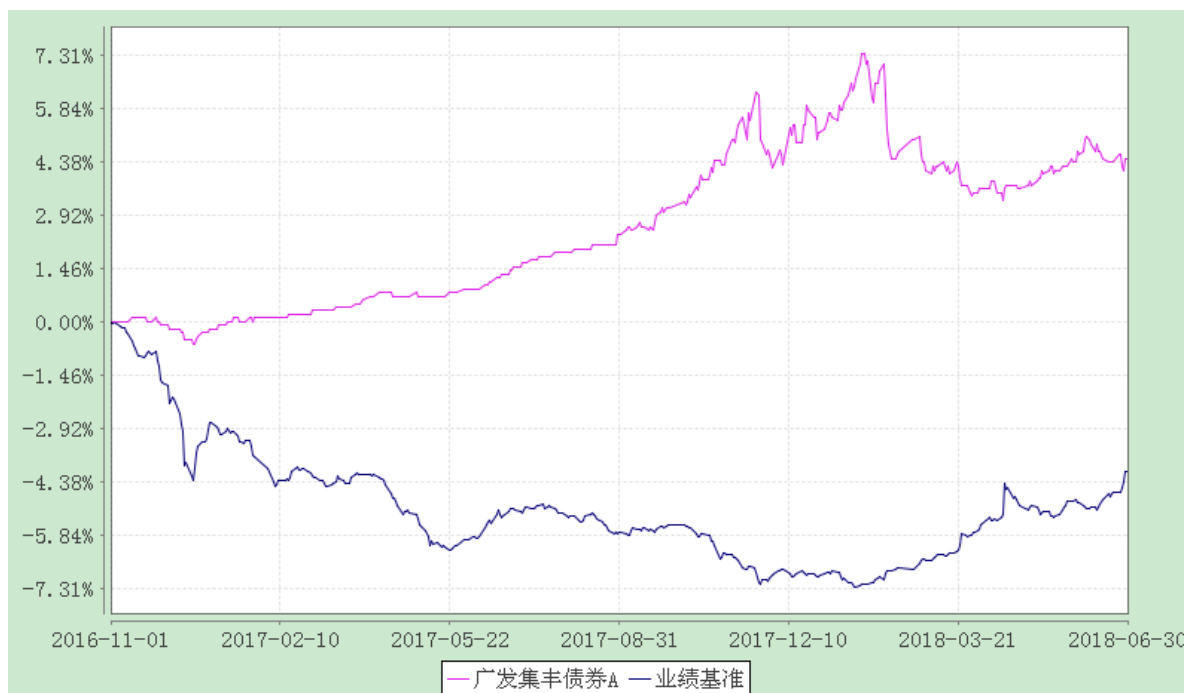
## 2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 广发集丰债券型证券投资基金

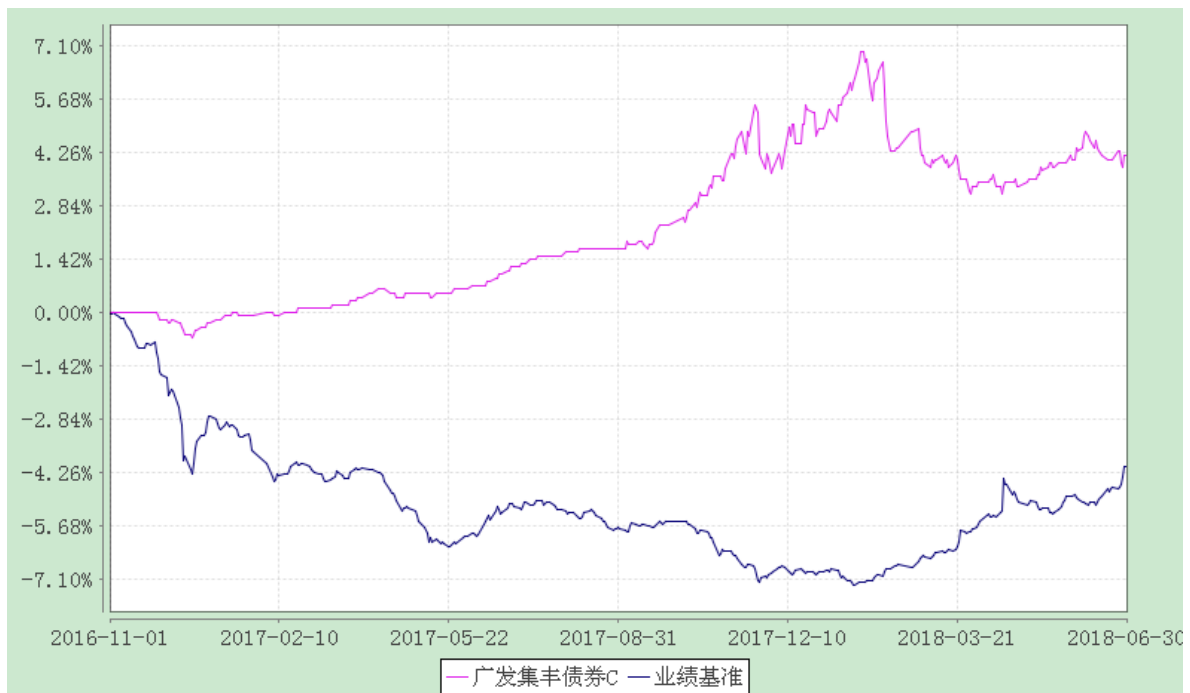
#### 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年11月1日至2018年6月30日)

#### (1) 广发集丰债券A:



#### (2) 广发集丰债券C:





## 第十三部分 基金的费用

### 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、从C类基金份额的基金财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、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 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0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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：

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

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 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 0.50%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付（由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等），基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。

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、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，履行适当程序后，调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前在至少一种指定媒介上公告。

#### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对原广发集丰债券型证券投资基金更新的招募说明书的内容进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“第二部分 释义”部分，更新了“银行业监督管理机构”的内容。
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关内容。
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，更新了注册登记机构及会计师事务所的信息。
- 5、在“第八部分 基金的投资”部分，更新了截至 2018 年 9 月 30 日的基金投资组合报告。
- 6、在“第九部分 基金的业绩”部分，更新了截至 2018 年 6 月 30 日的基金业绩。
- 7、在“第十九部分 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了基金管理人的相关信息。

广发基金管理有限公司  
二〇一八年十二月十四日