

中加纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要  
（2018年第2号）

基金管理人：中加基金管理有限公司  
基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

## 重要提示

中加纯债分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2014 年 11 月 15 日证监许可【2014】【1205】号文准予募集注册，本基金基金合同于 2014 年 12 月 17 日正式生效。根据基金合同的约定，本基金于 2016 年 12 月 23 日转换为不分级的证券投资基金，基金名称相应变更为中加纯债债券型证券投资基金，基金合同及托管协议名称及有关条款亦做相应变更，原仅适用于中加纯债分级债券型证券投资基金的条款自然失效。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购基金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，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，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，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预期收益和预期风险较低的基金品种，其风险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，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

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,由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 12 月 17 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日。(财务数据未经审计)

## 一、 基金管理人

### (一) 基金管理人简况

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：夏英

设立日期：2013 年 3 月 27 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字【2013】247 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：4.65 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：400-00-95526

股权结构：

中加基金管理有限公司股权比例为：北京银行股份有限公司 44%、加拿大丰业银行 28%、北京乾融投资（集团）有限公司 12%、中地种业（集团）有限公司 6%、有研科技集团有限公司 5%、绍兴越华开发经营有限公司 5%。

基金管理情况：目前基金管理人旗下管理二十七只基金，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）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加瑞盈债券型证券投资基金（原中加心安保本混合型证券投资基金）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加丰盈纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债

券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加颐睿纯债债券型证券投资基金(A/C)、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金(A/C)、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金(A/C)、中加颐智纯债债券型证券投资基金。

## (二) 主要人员情况

### 1、董事会成员

夏英先生, 董事长, 伦敦商学院金融硕士学位, 于1996年加入北京银行, 历任办公室副主任, 航天支行行长, 阜裕管辖行行长, 资金交易部副总经理等职务。夏先生具有丰富的金融业工作经验, 于2013年5月加入中加基金管理有限公司。

冯丽华女士, 副董事长, 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副行长。

张少明先生, 董事, 工学博士, 现任中国钢研科技集团有限公司党委书记、董事长。自1984年始, 张先生先后在北京有色金属研究总院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、副院长等职务, 2013年3月至2018年9月任有研总院院长(改制后任董事长)、书记。

施礼安先生(Peter Slan), 董事, 现任职丰业国际财富管理高级副总裁, 负责丰业银行在加拿大境外所有财富管理, 保险, 养老金及资产管理业务。施礼安先生在丰业银行已工作了20年, 在金融, 财富管理, 全球投资银行和股权资本市场等业务领域都担任过领导职位。他的主要社会工作包括Baycrest基金会董事, 卑街联合犹太人上诉内阁副主席。施礼安先生是特许账户和特许专业会计师, 持有多伦多大学罗特曼管理学院的工商管理硕士(MBA)学位。

周美思女士(Juliana Chow), 董事, 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30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。

刘素勤女士，董事，首都经济贸易大学经济学学士，助理经济师，于1998年7月加入北京银行。刘女士于2017年1月至今担任北京银行资金运营中心总经理，2015年2月至2017年1月担任北京银行资金运营中心副总经理，2008年12月至2015年2月担任北京银行资金交易部副总经理，2006年7月至2008年12月担任北京银行资金交易部总经理助理。之前，刘女士先后在北京银行天桥支行、总行计划财务部、总行资金交易部从事相关工作。

耿拥军先生，董事，耿先生在商贸经营、房地产开发和物业管理、典当及投融资领域具有丰富管理经验，创办北京昊润房地产开发有限公司、北京富润物业管理有限公司、北京金城典当有限责任公司、北京乾融投资(集团)有限公司等企业并担任董事长职务。耿先生现担任西城区政协委员、北京市工商联常委，民建北京企业家委员会副主任。

张建设先生，董事，1984年7月毕业于西北农业大学(现西北农林科技大学)经济管理专业，获农业经济管理学士学位；1984年7月至1996年5月就职于农业部农村合作经济经营管理总站、农业物资司、农业物资供销总公司，先后任职员、财务处长，高级经济师；自2003年至今，先后担任中地种业有限公司董事长兼总经理、中地种业(集团)有限公司董事长兼总裁、北京中地种畜有限公司董事长兼总经理、中地乳业集团有限公司董事长、中国中地乳业控股有限公司董事长兼总裁等职务；同时担任中国畜牧业协会副会长、中国奶业协会副会长。

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、计划资金部总经理、董事会办公室主任、纪委副书记等职务。

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教授、博士生导师。

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，在苏州琨玉前程投资管理有限公司担任董事长等职务。

## 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。

希琳（ShirleyShe）女士，监事，厦门大学学士，加拿大达尔豪西大学（DalhousieUniversity）工商管理硕士MBA，拥有CIM、CIPM等专业资格证书，并长期在国际知名资产管理机构从事投资工作，在境外证券投资及产品研发方面具有丰富的经验。2000年4月至2013年7月历任加拿大丰业银行丰业证券高级投资顾问、丰业资产管理高级投资经理。2013年7月至2013年12月任加拿大丰业银行中国投资产品总监。2013年12月至今任中加基金市场营销部副总监。

边宏伟先生，职工监事，上海外国语大学学士、美国约翰霍普金斯大学国际金融学硕士，掌握扎实的金融及财务管理领域专业知识，具有丰富的经济金融及跨境金融管理工作经验。边宏伟先生自1993年至1999年任职于中国日报社，1999年至2003年任职于世界银行及国际货币基金组织，2004年至2013年于北京银行股份有限公司任零售银行部副总经理；2013年3月加入中加基金管理有限公司，现任市场营销部总监。

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，任监察稽核部总监助理。

### 3、总经理及其他高级管理人员

夏英先生, 董事长, 伦敦商学院金融硕士学位, 于1996年加入北京银行, 历任办公室副主任, 航天支行行长, 阜裕管辖行行长, 资金交易部副总经理等职务。夏先生具有丰富的金融业工作经验, 于2013年5月加入中加基金管理有限公司。

宗喆先生, 总经理, 高级经济师, 研究生学历。具有14年以上金融从业经验, 具备基金从业资格。曾供职于中国工商银行山东省分行、总行, 银华财富资本管理有限公司, 2017年6月30日起任中加基金管理有限公司副总经理, 分管产品开发和市场营销工作。2018年7月20日起任公司总经理。

魏忠先生 (JohnZhongWei), 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 (DynamicFunds, 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19日正式担任公司副总经理一职, 并主管风险管理业务。

刘向途先生, 督察长, 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, 此前, 曾任职于北京银行清华大学支行; 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 (负责人)。自2016年5月17日起, 任公司督察长。

### 4、基金经理

闫沛贤, 英国帝国理工大学金融学硕士、伯明翰大学计算机硕士学位。2008年至2013年曾任职于平安银行资金交易部、北京银行资金交易部, 担任债券交易员。2013年加入中加基金管理有限公司, 曾任中加丰泽纯债债券型证券投资基金基金经理 (2016年12月19日至2018年6月22日), 现任投资研究部副总监兼固定收益部总监、中加货币市场基金基金经理 (2013年10月21日至今)、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理 (2014年3月24日至今)、中加纯债债券型证券投资基金基金经理 (2014年12月17日至今)、中加心享灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2015年12月28日至今)、中加颐合纯债债券型证券投资基金基金经理 (2018年9月13日至今)、中加颐鑫纯债债



券型证券投资基金基金经理（2018年11月8日至今）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理（2018年11月27日至今）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年12月13日至今）。

#### 5、投资决策委员会

投资决策委员会成员包括公司董事长夏英先生，总经理宗喆先生，副总经理魏忠先生，督察长刘向途先生，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、廉晓婵女士，投资研究部首席宏观研究员李继民先生，监察稽核部总监助理王雯雯女士。

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

根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 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财产分别管理、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、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 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、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财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、有关法律法规和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) 利用基金财产或职务之便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最大利益。

- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三人谋取利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 或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,对公司内部控制和风险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风险管理的披露真实、准确,并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：广州农村商业银行股份有限公司（简称：广州农村商业银行）

住所：广州市黄埔区映日路9号

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号

成立时间：2006年10月27日

注册资本：98.08亿元人民币

存续期间：持续经营

法定代表人：王继康

批准设立文号：银监复[2009]484号

基金托管业务资格批准文号：证监许可[2014]83号

联系人：李中良

电话：（020）22389371

传真：（020）28019340

#### 2、主要人员情况

广州农村商业银行总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运营室、监督稽核室、产品营销室、系统管理室，部门全体人员均具备本科以上学历及相关从业经验。

黄镇辉先生，经济学硕士。曾任广州市商业银行股份有限公司会计计划资金业务交易员、广发基金管理有限公司货币基金经理、广州市信用合作联社资金业务部交易科经理、副总经理、广州农村商业银行总行金融市场部副总经理、金融同业中心总经理、大连业务中心总经理。2016年2月起，担任广州农村商业银行总行资产托管部总经理。

汪大伟先生，法学学士，经济师。曾任广州农商行总行合规风险部科员、支行公司业务部经理、珠江村镇银行营销管理部负责人、总行金融市场管理部总经理助理、金融同业部总经理助理等职务。2018年4月起，担任广州农村商业银行总行资产托管部总经理助理。

### 3、基金托管业务经营情况

广州农村商业银行于2014年1月9日经中国证监会和中国银监会共同核准,获得证券投资基金托管资格。2015年10月24日,经中国保险监督管理委员会批准,广州农村商业银行获得保险资产托管业务资格。广州农村商业银行资产托管部秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依托严格的内控管理、先进的营运系统、专业的服务团队和丰富的业务经验,严格履行资产托管人职责,为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务。目前托管产品涵盖公募基金、基金专户、银行理财、券商资管、信托计划、股权投资基金等,截至2018年6月末,托管证券投资基金17只,托管资产规模达5553亿元。

#### (二) 托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定,守法经营、规范运作,确保业务的安全、稳健运行,保证基金资产的安全完整,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

广州农商银行资产托管业务内部控制组织结构由广州农商银行风险管理部、内部审计部、资产托管部内设监督稽核室及资产托管部各业务科室共同组成。总行风险管理部负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设监督稽核室,配备专职稽核监察人员,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务科室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按

照“内控优先”的原则，新设科室或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

### (三) 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

托管人根据《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同的规定，对基金投资范围、投资对象、投资比例、融资比例、基金投资禁止行为、基金资产净值计算、费用的计提和支付、基金收益分配、信息披露以及其他有关基金投资和运作的事项等进行监督。

1、基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同规定的行为，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认。在限期内，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。基金管理人违反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。

2、对基金托管人按照法规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数据资料和制度等。

3、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，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。



### 三、相关服务机构

#### 1、直销中心

名称：中加基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区南纬路 35 号

注册地址：北京市顺义区仁和镇顺泽大街 65 号 317 室

法定代表人：夏英

全国统一客户服务电话：400-00-95526

传真：010-83197627

联系人：江丹

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：张东宁

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

##### (2) 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：上海市黄浦区中山东二路 70 号

法定代表人：胡平西

客户服务电话：4006-962999、021-962999

网址：www.srcb.com

##### (3) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

电话: 010-63636153

传真: 010-63639709

客户服务电话: 95595

网址: [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(4) 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](http://www.hebbank.com)

(5) 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: 上海市长宁路 1200 号贝多芬广场 511 室

客户服务电话: 95564

网址: <http://www.lxzq.com.cn>

(6) 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: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

客户服务电话: 400-067-6266

网址: <http://www.leadfund.com.cn>

(7) 广州农商行股份有限公司

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

客户服务电话: 95313

网址: <http://www.grcbank.com>

(8) 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

客户服务电话: 95553/400-888-8001

网址: <http://www.htsec.com/htsec.html>

(9) 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

客户服务电话: 400-990-8826

网址: <http://www.citicsf.com>

(10) 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

客户服务电话: 010-62675369

网址: <http://www.xincai.com>

(11) 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号凯科大厦7楼

客户服务电话: 4008202819

网址: <https://tty.chinapnr.com/>

(12) 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

客户服务电话: 400-821-5399

网址: <https://www.noah-fund.com>

(13) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: (上海)自由贸易试验区陆家嘴环路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

客户服务电话: 4008219031

网址: <https://www.lufunds.com>

(14) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址:北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 16 层

客户服务电话:4001661188

网址:<http://money.jrj.com.cn>

(15) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址:珠海市横琴区宝华路 6 号 105 室-3491

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 12 楼  
B1201-1203

客户服务电话:020-89629066

网址:<https://www.yingmi.cn/>

(16) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际 20 楼  
2005 室

办公地址:新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 号楼

法定代表人:韩志谦

客户服务电话:400-800-0562

网址:[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(17) 申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址:上海市徐汇区常熟路 171 号

法定代表人:李梅

客户服务电话:95523 或 400-889-5523

网址:[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(18) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 28 层

法定代表人:蒋煜

客户服务电话:400-818-8866

网址:[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

(19) 北京微动利投资管理有限公司

注册地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341

室

办公地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341

室

法定代表人:梁洪军

客户服务电话:400-819-6665

网址:www.buyforyou.com.cn

(20) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址:南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道 1 号易购楼

法定代表人:刘汉青

客户服务电话:95177

网址:www.snjijin.com

(21) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址:南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址:上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人:袁顾明

客户服务电话:400-928-2266

网址:www.dtfunds.com

(22) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址:北京市西城区华远北街 2 号西单通港大厦 12 层 1212

法定代表人:李悦

客户服务电话:4008-980-618

网址:http://www.chtfund.com

(23) 上海万得基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址:上海陆家嘴金融区福山路 33 号建工大厦 9 楼

法定代表人:王廷富

客户服务电话:400-821-0203

网址:www.520fund.com.cn

(24) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址: 上海市昆明路 518 号北美广场 A1002

法定代表人: 王翔

客户服务电话: 400-820-5369

网址: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(25) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人: 林卓

客户服务电话: 400-6411-999

网址: [www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

(26) 上海中正达广投资管理有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人: 黄欣

客户服务电话: 400-6767-523

网址: [www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

(27) 天津国美基金销售有限公司

注册地址: 天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址: 北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人: 丁东华

客户服务电话: 400-111-0889

网址: [www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(28) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人: 王伟刚

客户服务电话: 400-619-9059

网址: <http://trade.fundzone.cn>

(29) 蚂蚁(杭州)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: 上海市浦东新区峨山路 91 弄陆家嘴软件园 10 号楼 7 楼

法定代表人: 陈柏青

客户服务电话: 4000-766-123

网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(30) 北京坤元基金销售有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 B 座 5 层

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 B 座 5 层

法定代表人: 李雪松

客服服务电话: 400-818-5585

网址: <http://www.kunyuanfund.com>

(31) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址: 北京市大兴区亦庄经济开发区科创 11 街 18 号京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人: 陈超

客户服务电话: 95118

网址: <http://fund.jd.com>

(32) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼

法定代表人: 孙树明

客户服务电话: 020-95575

网址: <https://hd.gf.com.cn>

(33) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址: 河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间

办公地址: 北京市朝阳区酒仙桥 6 号楼国际电子城 B 座

法定代表人：王旋

客户服务电话：4000555671

网址：[www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

(34) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

网址：<https://www.zlfund.cn/>

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销售本基金，并及时公告。

(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：夏英

全国统一客户服务电话：400-00-95526

传真：010-66226080

(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

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：契约型开放式基金

#### 六、基金的投资目标

在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。

#### 七、基金的投资方向

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

在本基金转换为不分级的开放式债券型基金后，本基金的投资组合比例为：债券资产的比例不低于基金资产的80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金不直接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或增发新股，可转债仅投资二级市场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。

## 八、基金的投资策略

本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。分级运作终止转换为不分级的开放式债券型基金后,将更加注重组合的流动性,将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置,动态调整组合久期和信用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。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,并满足每次开放日、过渡期的流动性需求,本基金在每个分级运作周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、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、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主要考虑久期、流动性和信用风险三方面。在久期方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期；在流动性方面，根据中小企业私募债整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性良好；在信用风险方面，对个券信用资质

进行详尽的分析,对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量,尽可能地避免信用风险。

#### 7、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

本基金业绩比较基准:中证全债指数

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数有限公司编制并发布的首只债券类指数。样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

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,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,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,而无需召开基金份额持有人大会。

### 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预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险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。

### 十一、基金投资组合报告

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。

以下内容摘自本基金 2018 年第 3 季度报告：

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 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截止 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

金额单位：人民币元

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	580,988,400.00	95.92
	其中：债券	580,988,400.00	95.92
	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	9,405,258.53	1.55
8	其他资产	15,323,534.34	2.53
9	合计	605,717,192.87	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

##### (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港股通投资股票。

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(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	63,575,600.00	14.55
	其中：政策性金融债	63,575,600.00	14.55
4	企业债券	103,419,500.00	23.67
5	企业短期融资券	84,701,500.00	19.39
6	中期票据	329,291,800.00	75.37
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	580,988,400.00	132.98

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101564058	15哈供热MTN001	400,000	40,376,000.00	9.24
2	101763015	17金红叶MTN002	400,000	40,340,000.00	9.23
3	101555007	15邯鄯矿业MTN001	400,000	40,252,000.00	9.21
4	101662022	16三安MTN001	400,000	40,172,000.00	9.19
5	136386	16财信债	400,000	39,744,000.00	9.10

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

(1) 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 本报告期内，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) 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,582.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,236,658.05
5	应收申购款	74,293.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,323,534.34

(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存在尾差。

(九) 基金净值表现

1、自基金合同生效以来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

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12月23日至2017年12月31日	4.40%	0.03%	0.41%	0.06%	3.99%	-0.03%
2018年1月1日至2018年9月30日	4.03%	0.13%	5.76%	0.08%	-1.73%	0.05%

2、自基金合同生效以来基金份额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

中加纯债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历史走势对比图

(2016年12月23日-2018年09月30日)



注: 1、本基金转型生效日期为2016年12月23日, 截至本报告期末, 本基金转型已满一年。



2、按基金合同规定,本基金建仓期为6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。

## 十二、基金的费用和税收

### (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、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、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：

$$H=E \times 0.40\% \div 365$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 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：

$$H=E \times 0.10\% \div 365$$

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，由基金管理人向基

金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金转换为不分级的开放式基金后,不收取销售服务费。

上述“(一)基金费用的种类”中第4—9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

在法律、法规规定的范围内,且对基金份额持有人无实质不利影响的前提下,基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况酌情协商调整基金管理费率、基金托管费率。降低基金管理费率、基金托管费率,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前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项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十三、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“重要提示”的相关内容。

（二）更新了“第二部分 释义”的相关信息。

（三）更新了“第三部分 基金管理人”的相关信息。

（四）更新了“第四部分 基金托管人”的相关信息。

（五）更新了“第五部分 相关服务机构”中的相关信息。

（六）在“第九部分 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。

（七）在“第二十一部分 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《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。