

鑫元基金管理有限公司

鑫元得利债券型证券投资基金
更新招募说明书摘要
(2018年第1号)

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

二〇一八年四月

重要提示

鑫元得利债券型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）于2016年【5】月【27】日经中国证监会证监许可[2016]【1161】号文注册募集。

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。

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，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高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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，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：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，由于基金投资人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等。

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2月17日，有关财务数据、净值表现截止日为2017年12月31日。

目 录

第一部分	基金管理人.....	5
第二部分	基金托管人.....	16
第三部分	相关服务机构.....	22
第四部分	基金的募集.....	25
第五部分	基金的投资目标和投资范围.....	26
第六部分	基金的投资策略.....	27
第七部分	业绩比较基准.....	30
第八部分	风险收益特征.....	31
第九部分	基金投资组合报告.....	32
第十部分	基金的业绩.....	35
第十一部分	基金的费用与税收.....	36
第十二部分	对招募说明书更新部分的说明.....	38

第一部分 基金管理人

一、基金管理人情况

名称：鑫元基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层217室

办公地址：上海市静安区中山北路909号12楼

法定代表人：肖炎

成立日期：2013年8月29日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1115号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币17亿元

存续期限：永续经营

联系电话：021-20892000

股权结构：

股东名称	出资比例
南京银行股份有限公司	80%
南京高科股份有限公司	20%
合计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

肖炎先生，董事长。现任鑫元基金管理有限公司董事长兼党委书记。曾在中国农业银行任职，历任南京银行总行计划财务部总经理、常州分行行长、党委书记。

徐益民先生，董事。南京大学商学院EMBA，现任南京高科股份有限公司董事长兼党委书记。历任国营第七七二厂财务处会计、企管处干事、四分厂会计、劳资处干事、十八分厂副厂长、财务处副处长、处长、副总会计师兼处长，南京（新港）经济技术开发区管委会会计财处处长，南京新港开发总公司副总会计师，

南京新港高科技股份有限公司董事长兼总裁、兼任党委书记。

张乐赛先生，董事。中南财经政法大学经济学硕士，现任鑫元基金管理有限公司总经理，兼任鑫沅资产管理有限公司执行董事。历任南京银行债券交易员，诺安基金管理有限公司固定收益部总监、同时兼任诺安基金债券型、保本型、货币型基金的基金经理、鑫元基金管理有限公司常务副总经理。

焦世经先生，独立董事。南京大学文学学士，现任中信泰富（南京）投资有限公司董事长、苏美达股份有限公司独立董事。曾在扬州太安砖瓦厂及对外经济贸易部对外援助局工作，历任中国建设银行江苏省分行秘书、办公室副主任、国际业务部总经理，中国投资银行南京分行行长及党委书记、总行副行长及党委书记，中信银行股份有限公司南京分行副行长、行长、党委书记。

安国俊女士，独立董事。中国人民大学财政学博士，现任中国社会科学院金融研究所副研究员、硕士生导师。历任财政部主任科员、中国工商银行总行金融市场部高级经理。

王艳女士，独立董事。上海交通大学金融学博士，现任深圳大学经济学院金融系副教授。历任北京大学经济学院应用经济学博士后流动站职员，中国证监会深圳监管局行业调研主任科员等。

2、监事会成员

潘瑞荣先生，监事长。硕士研究生，现任南京银行股份有限公司审计稽核部总经理。历任南京市财政局企业财务管理处主任科员，南京市城市合作银行财务会计处副处长，南京市商业银行会计结算部总经理等。

陆阳俊先生，监事。研究生学历，现任南京高科股份有限公司副总裁、财务总监。历任南化集团建设公司财务处会计，南京高科股份有限公司计划财务部主管、副经理、经理等。

马一飞女士，职工监事。上海师范大学经济学学士，现任鑫元基金管理有限公司综合管理部人事主管。曾任职于汉高中国投资有限公司市场部，中智上海经济技术合作公司，纽银梅隆西部基金管理有限公司综合管理部。

王博先生，职工监事。上海财经大学工商管理硕士，现任鑫元基金管理有限公司综合管理部财务主管。曾担任南京银行股份有限公司财务管理、浦发银行金桥支行柜员。

3、公司高级管理人员

肖炎先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张乐赛先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

李晓燕女士，督察长。上海交通大学工学学士，历任安达信华强会计师事务所审计员，普华永道中天会计师事务所高级审计员，光大保德信基金管理有限公司监察稽核高级经理，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部总监，现兼任鑫沅资产管理有限公司及上海鑫沅股权投资管理有限公司监事。

李雁女士，副总经理。东南大学动力工程学士。曾任职于南京信联证券计划财务部，历任南京城市合作银行资金交易及结算员，南京银行资金交易部部门经理、金融同业部副总经理，现兼任市场营销部总监。

王辉先生，副总经理。澳门科技大学工商管理硕士，历任中国人民银行南京市分行金融机构管理方面的工作，南京证券上海营业部副总经理，世纪证券上海营业部总经理及上海营销中心总经理、鑫元基金管理有限公司总经理助理。现兼任上海鑫沅股权投资管理有限公司总经理。

陈宇先生，副总经理。上海交通大学高级金融学院 EMBA 工商管理硕士、复旦大学软件工程硕士，历任申银万国证券电脑中心高级项目经理，中银基金管理有限公司信息技术部总经理、监事会成员，鑫元基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

颜昕女士，学历：工商管理，硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2009年8月，任职于南京银行股份有限公司，担任交易员。2013年9月加入鑫元基金担任交易员，2014年2月至8月，担任鑫元基金交易室主管，2014年9月起担任鑫元货币市场基金的基金经理助理，2015年6月26日起担任鑫元安鑫宝货币市场基金的基金经理，2015年7月15日起担任鑫元货币市场基金的基金经理，2016年1月13日起担任鑫元兴利债券型证券投资基金的基金经理，2016年3月2日起担任鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金（原鑫元合丰分级债券型证券投资基金）的基金经理，2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理，2016年6月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理，2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理，2016年8月17日起担任鑫元得利债

券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年12月22日起担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月13日起担任鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金(原鑫元瑞利债券型证券投资基金)的基金经理,2017年3月17日起担任鑫元添利债券型证券投资基金的基金经理,2017年12月13日起担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;同时兼任基金投资决策委员会委员。

赵慧女士,学历:经济学专业,硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010年7月任职于北京汇致资本管理有限公司,担任交易员。2011年4月起在南京银行金融市场部资产管理部和南京银行金融市场部投资交易中心担任债券交易员,有丰富的银行间市场交易经验。2014年6月加入鑫元基金,担任基金经理助理。2014年7月15日起担任鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金的基金经理助理,2014年10月20日起担任鑫元合享分级债券型证券投资基金的基金经理助理,2014年12月2日起担任鑫元半年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,2014年12月16日起担任鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(原鑫元合丰分级债券型证券投资基金)的基金经理助理,2015年7月15日起担任鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理,2016年1月13日起担任鑫元兴利债券型证券投资基金的基金经理,2016年3月2日起担任鑫元货币市场基金的基金经理,2016年3月9日起担任鑫元汇利债券型证券投资基金的基金经理,2016年6月3日起担任鑫元双债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年7月13日起担任鑫元裕利债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月17日起担任鑫元得利债券型证券投资基金的基金经理,2016年10月27日起担任鑫元聚利债券型证券投资基金的基金经理,2016年12月22日起担任鑫元招利债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月13日起担任鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金(原鑫元瑞利债券型证券投资基金)的基金经理,2017年3月17日起担任鑫元添利债券型证券投资基金的基金经理,2017年12月13日起担任鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;同时兼任基金投资决策委员会委员。

5、基金投资决策委员会成员

基金投资决策委员会是公司基金投资最高决策机构,根据法律法规、监管规范性文件、基金合同与公司相关管理制度对各项重大投资活动进行管理与决策。基金投资决策委员会成员如下:

张乐赛先生: 总经理

丁玥女士: 鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理兼研究部总监

颜昕女士: 鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元货币市场基金、鑫元合享债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(原鑫元合丰分级债券型证券投资基金)、鑫元兴利债券型证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利债券型证券投资基金、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理

郑文旭先生: 鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理

赵慧女士: 鑫元货币市场基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利债券型证券投资基金、鑫元添利债券型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金(原鑫元合丰分级债券型证券投资基金)、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理

王美芹女士: 鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理

陈令朝先生：鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

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、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，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、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项，履行信息披露及报告义务；

9、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

10、按规定保存基金财产管理业务活动的记录、会计账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

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、法律法规和中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2、基金管理人承诺防止下列行为的发生：

- (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) 利用基金财产或者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) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理, 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, 不从事以下活动:

- (1) 越权或违规经营;
- (2) 违反基金合同或托管协议;
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (6) 玩忽职守、滥用职权;
- (7) 违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄露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;
- (8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外, 直接或间接进行其他股票投资;
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
- (10) 违反证券交易场所业务规则, 利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;
- (11) 贬损同行, 以抬高自己;
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- (13) 以不正当手段谋求业务发展;
- (14) 有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象;
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露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；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人扎实推进全面风险管理与全员风险管理，以制度建设作为风险管理的基石，以组织架构作为风险管理的载体，以制度的切实执行作为风险管理的

核心,以内部独立部门的有效监督作为风险管理的关键,以充分使用先进的风险管理技术和方式方法作为风险管理的保障,强调对于内部控制与风险管理的持续关注 and 资源投入。

1、内部控制目标

(1) 保证基金管理人经营运作遵守国家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。

(2) 防范和化解经营风险,提高经营管理效益,确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整,实现持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金管理人和基金财务及其他信息的真实、准确、及时、完整。

2、内部控制原则

(1) 健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内部控制手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内部控制的有效执行。

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立,基金资产、固有财产、其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。基金管理人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。

3、内部控制组织体系与职责

基金管理人已建立健全董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构,并分别明确风险管理职能与责任。

(1) 董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。董事会下设风险控制与合规审计委员会,负责研究、确定风险管理理念,指导风险管理体系的建设。

(2) 经营管理层负责组织、部署风险管理工作。经营管理层设风险控制委员会,负责确定风险管理理念、原则、目标和方法,促进风险管理环境、文化的形成,组织风险管理体系建设,审议风险管理制度和流程,审议重大风险事件。

(3) 监察稽核部作为独立的风险管理部门,对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督,保证内部控制制度的有效落实。监察稽核部在督察长的领导下负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风

险的控制和管理,督促、检查各业务部门、各业务环节的制度执行情况。

(4) 各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序,执行风险管理措施。根据风险管理工作要求,健全完善规章制度和操作流程,严格遵守风险管理制度、流程和限额,严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序,对本部门发生风险事件承担直接责任,及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

4、内部控制制度体系

基金管理人依据合法合规性、全面性、审慎性、适时性等内部控制制度制订原则,已构建较为合理完备并易于执行的内部控制与风险管理制度体系,具体包括四个层面:

(1) 一级制度:包括公司章程、股东会议事规则、董事会议事规则、监事会议事规则、董事会专门委员会会议事规则等公司治理层面的经营管理纲领性制度。

(2) 二级制度:包括内部控制大纲、风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等公司基本管理制度。

(3) 三级制度:包括公司范围内适用的全局性专项管理制度与各业务职能部门管理制度。

(4) 四级制度:包括各业务条线单个部门内部或跨部门层面的业务规章、业务规则、业务流程、操作规程等具体细致的规范化管理制度。

5、内部控制内容

(1) 控制环境。控制环境构成基金管理人内部控制的基础,控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

(2) 风险评估。基金管理人建立科学严密的风险评估体系,对内外部风险进行识别、评估和分析,及时防范和化解风险;建立完整的风险控制程序,包括风险识别、风险评估、风险控制和风险监督;对各部门和各业务循环存在的风险点进行识别评估,并建立相应的控制措施;使用科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实行定量分析和管理。

(3) 控制措施。基金管理人设立顺序递进、权责统一、严密有效的多道内部控制防线,制定并执行包括授权控制、资产分离、岗位分离、业务流程和操作规程、业务记录、绩效考核等在内的多样化的具体控制措施。

(4) 信息沟通。基金管理人维护内部控制信息沟通渠道的畅通,建立清晰的报告系统。

(5) 内部监控。基金管理人建立有效的内部监控制度,设置督察长和独立的监察稽核部门,对内部控制制度的执行情况进行持续的监督与反馈,保证内部控制制度的有效落实,并评价内部控制的有效性,根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况适时改进。

6、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。本公司声明以上关于风险管理和内部控制的披露真实、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。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

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

成立时间：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；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；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外币有价证券；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]105 号

联系人：朱萍

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，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(含合肥分中心)五个职能处室。目前, 上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、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。

2、主要人员情况

高国富, 男, 1956 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; 中国太平洋保险(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。第十二届全国政协委员。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总经理, 上海市金融服务办挂职任机构处处长、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。

刘长江, 男, 1966 年出生, 硕士研究生, 经济师。历任工商银行总行教育部主任科员, 工商银行基金托管部综合管理处副处长、处长, 上海浦东发展银行总行基金托管部总经理, 上海浦东发展银行公司及投资银行总部资产托管部、企业年金部、期货结算部总经理, 上海浦东发展银行公司及投资银行总部副总经理兼资产托管部、企业年金部、期货结算部总经理, 上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。现任上海浦东发展银行总行金融机构部、资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止 2017 年 12 月 31 日, 上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 2817.65 亿元, 比去年末增长 53.08%。托管证券投资基金共一百二十九只, 分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、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、银

华永泰债券型基金、长信利众债券基金(LOF)、华富保本混合型证券投资基金、中海策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年、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、华富恒财分级债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、博时产业债纯债基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、国联安鑫富混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、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、国寿安保稳健回报基金、国投瑞银新成长基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、国联安鑫悦基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、国联安安稳保本基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、华富诚鑫灵活配置基金、富安达长盈保本基金、中信建投稳溢保本基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、国泰添益混合基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛定期开放基金、华富元鑫灵活配置基金、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、鹏华兴锐定期开放基金、汇添富保鑫保本混合基金、景顺长城景颐盛利债券基金、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、广发汇瑞一年定开债券基金、国联安鑫盛混合基金、汇安嘉汇纯债债券基金、鹏华普泰债券基金、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、国泰景益灵活配置混合基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安丰泰灵活配置混合基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证

500 指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、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、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、长盛盛泰灵活配置混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富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、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫珏主题轮动混合基金、中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、博时鑫禧灵活配置混合基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、中金价值轮动灵活配置混合基金等。

二、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、规范运作的经营思想。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，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。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条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

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各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、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、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密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方案,定期组织灾备演练,建立重大事项报告制度;在基金运作办公区域建立健全安全监控系统,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,排查风险隐患。

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

1、监督依据

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

- (1)《中华人民共和国证券法》;
- (2)《中华人民共和国证券投资基金法》;
- (3)《公开募集证券投资基金运作管理办法》;
- (4)《证券投资基金销售管理办法》;
- (5)《基金合同》、《基金托管协议》;
- (6)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,及时提示基金管理人违规风险。

3、监督方法

(1)资产托管部设置核算监督岗位,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交易行为的监督职责,规范基金运作,维护基金投资人的合法权益,不受任何外界力量的干预;

(2)在日常运作中,凡可量化的监督指标,由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督,实现系统的自动跟踪和预警;

(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)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、临时日报、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、邮件、书面提示函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违规事项进行复查,如果基金管理人未予纠正,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,应及时提供有关情况和资料。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

鑫元基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 217 室

办公地址：上海市静安区中山北路 909 号 12 楼

法定代表人：肖炎

联系电话：021-20892066

传真：021-20892080

联系人：周芹

客户服务电话：4006066188，021-68619600

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址（含微信交易）：www.xyamc.com（微信名称：鑫元基金微理财（微信账号：xyamc_ebuy））。

2、销售机构

（1）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

客户服务电话：95528

网站：www.spdb.com.cn

（2）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法人代表人：燕斌

客服电话：400-046-6788

网站：www.91fund.com.cn

（3）天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

法定代表人：李修辞

客服电话：:010-59013895

网站：<http://www.wjasset.com>

（4）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省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 18 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

二、登记机构

鑫元基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 217 室

办公地址：上海市静安区中山北路 909 号 12 楼

法定代表人：肖炎

联系电话：021-20892000

传真：021-20892111

联系人：包颖

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：中国上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层

办公地址：中国上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层

负责人：廖海

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、姜亚萍

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 号

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：021-61238888

传真：021-61238800

联系人：薛竞、陈轶杰

经办注册会计师：薛竞、陈轶杰

第四部分 基金的募集

一、基金运作方式与类型

基金名称：鑫元得利债券型证券投资基金

基金类别：债券型

基金运作方式：契约型、开放式

第五部分 基金的投资目标和投资范围

一、投资目标

本基金在严格控制投资组合风险的基础上,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括但不限于协议存款、定期存款及其他银行存款等)、同业存单、货币市场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相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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。

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%,现金或者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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

第六部分 基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。

2、债券投资组合策略

在债券组合的构建和调整上,本基金综合运用久期配置、期限结构配置、收益率曲线策略、杠杆放大策略、套利策略等组合管理手段进行日常管理。

(1) 久期配置策略

久期配置是根据对宏观经济数据、金融市场运行特点等方面的分析来确定组合的整体久期,在遵循组合久期与运作周期的期限适当匹配的前提下,有效地控制整体资产风险。当预测利率上升时,适当缩短投资组合的目标久期,预测利率水平降低时,适当延长投资组合的目标久期。

(2) 期限结构配置策略

本基金在对宏观经济周期和货币政策分析下,对收益率曲线形态可能变化给予方向性的判断;同时根据收益率曲线的历史趋势、未来各期限的供给分布以及投资者的期限偏好,预测收益率期限结构的变化形态,从而确定合理的组合期限结构。通过采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从而达到预期收益最大化的目的。

(3) 收益率曲线策略

收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化,相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略;其次,通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较,可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。

(4) 杠杆策略

杠杆放大操作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,以期获取超额收益的操作方式。

(5) 套利策略

在市场低效或无效状况下,本基金将根据市场实际情况,积极运用各类套利方法对固定收益资产投资组合进行管理与调整,捕捉交易机会,以获取超额收益。

1) 回购套利

本基金将适时运用多种回购交易套利策略以增强静态组合的收益率,比如运用回购与现券的套利、不同回购期限之间的套利进行相对低风险套利操作等,从而获得杠杆放大收益。

2) 跨市场套利

跨市场套利是指利用同一只债券类投资工具在不同市场(主要是银行间市场与交易所市场)的交易价格差进行套利,从而提高固定收益资产组合的投资收益。

3、债券投资策略

(1) 信用债投资策略

本基金将重点投资信用类债券,以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源,本基金将在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的高投资收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响,一是市场信用利差曲线的走势;二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析,判断市场信用利差曲线整体及分行业走势,确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资,减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。

(2) 中小企业私募债券的投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,并限制投资者数量上限,整体流动性相对较差。同时,受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中,应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为,投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面,并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素,确定最终的投资决策。对于中小企业私募

债券，本基金的投资策略以持有到期为主。

(3) 证券公司短期公司债的投资策略

本基金在对证券公司短期公司债特点和发行证券公司基本面进行深入分析研究的基础上，通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其债券价值；采用多种定价模型以及证券公司基本面等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合实力较强的证券公司发行的短期公司债，获取稳健的投资回报。

4、资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

第七部分 业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率

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。

如果指数编制单位更改指数名称，或者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的业绩基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

第八部分 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高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

第九部分 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 17 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。

本投资报告中所载数据截止至 2017 年 12 月 31 日。本报告中财务资料未经审计。

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	128,248,770.00	96.95
	其中：债券	128,248,770.00	96.95
	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	1,727,034.30	1.31
8	其他资产	2,306,424.01	1.74
9	合计	132,282,228.31	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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

注：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	990,700.00	0.92

2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,716,000.00	13.74
	其中：政策性金融债	4,990,000.00	4.66
4	企业债券	52,937,070.00	49.41
5	企业短期融资券	39,968,000.00	37.31
6	中期票据	19,637,000.00	18.33
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	128,248,770.00	119.70

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	011758038	17 镇国投 SCP004	100,000	10,060,000.00	9.39
2	101356001	13 长沙先导 MTN001	100,000	10,046,000.00	9.38
3	041778001	17 宿迁经发 CP001	100,000	9,977,000.00	9.31
4	011772032	17 鲁钢铁 SCP005	100,000	9,970,000.00	9.31
5	122371	14 亨通 01	100,000	9,968,000.00	9.30

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

9.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

10. 投资组合报告附注

10.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

注：本报告期内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报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

10.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

注：本基金本报告期末未持有股票。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,728.76
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,304,695.25
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,306,424.01

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

第十部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

历史时间段本基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(截止时间 2017 年 12 月 31 日)

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 8 月 17 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	-0.50%	0.10%	-1.45%	0.14%	0.95%	-0.04%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	1.41%	0.06%	-0.19%	0.07%	1.60%	-0.01%
2017 年 7 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日	0.98%	0.05%	0.56%	0.04%	0.42%	0.01%
2017 年 10 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	0.30%	0.04%	-0.69%	0.05%	0.99%	-0.01%

第十一部分 基金的费用与税收

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易或结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 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 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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、公休日或不可抗力等，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 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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、公休日或不可抗力等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3—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、基金管理费、基金托管费的调整

在法律规定的范围内,基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,并在履行相关程序后调整基金管理人费率、基金托管费率。提高上述费率需经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前依照《信息披露办法》的有关规定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纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十二部分 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》及其他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,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

一、在“重要提示”中,更新了本招募说明书所载内容截止日、有关财务数据截止日和净值表现截止日。

二、在“第二部分 释义”部分,更新了相关词语的含义。

三、在“第三部分 基金管理人”部分,对基金管理人情况、主要人员情况的相关内容进行了更新。

四、在“第四部分 基金托管人”部分,对基金托管人的相关内容进行了更新。

五、在“第五部分 相关服务机构”部分,更新了基金份额发售机构、登记机构、审计基金财产的会计师事务所的相关信息。

六、在“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分,更新了基金份额申购和赎回的数量限制、赎回费率、拒绝或暂停申购的情形、暂停或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的情形及处理方式的相关内容。

七、在“第九部分 基金的投资”部分,更新了投资范围和投资限制,并更新了“投资组合报告”的内容,截止日期更新为2017年12月31日,该部分内容均按有关规定编制,并经本基金托管人复核。

八、在“第十部分 基金的业绩”部分,更新了“历史时间段本基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较”,截止日期更新为2017年12月31日,该部分内容均按照有关规定编制,并经本基金托管人复核。

九、在“第十二部分 基金资产估值”部分,更新了暂停估值的情形相关内容。

十、在“第十六部分 基金的信息披露”部分,更新了基金定期报告、临时报告相关内容。

十一、在“第十七部分 风险揭示”部分,更新了基金面临的的风险的相关内容。

十二、 在“第十九部分 基金合同的内容摘要”部分，更新了基金合同内容摘要的相关内容。

十三、 在“第二十部分 托管协议的内容摘要”部分，更新了基金管理人的注册资本、法定代表人、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查及暂停估值与公告基金份额净值情形的相关内容。

十四、 在“第二十一部分 对基金份额持有人的服务”部分，更新了投资者留言的栏目位置信息。

十五、 在“第二十二部分 其他应披露事项”部分，更新了本报告期内的信息披露事项。