德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可[2013]152号文核准募集。自2013年3月25日至2013年4月19日通过销售机构公开发售。本基金为契约开放式基金。本基金的基金合同于2013年4月25日成立正式生效。

重要提示

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可[2013]152号文核准募集,本基金的基金合同于2013年4月25日成立正式生效。

本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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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,投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。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,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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,由于基金份额持有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积极管理风险,本基金的特定风险等。从整体运作来看,基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。从两类份额看,德信A份额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率+1.20%,表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。德信B份额获得剩余收益,带有适当的杠杆效应,表现出预期风险较高,预期收益相对较高的特点。

基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2013年10月25日,投资组合报告为2013年第三季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2013年9月30日。

一、 基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:德邦基金管理有限公司
住所:上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层
办公地址:上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层
法定代表人:姚文平
成立时间:2012年3月27日
组织形式:有限责任公司
注册资本:人民币1.2亿元
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监许可[2012]249号
经营范围:基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务
存续期间:持续经营
联系人:刘利
联系电话:021-26010999

公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
德邦证券有限责任公司	49%
西子联合控股有限公司	31%
浙江省土产畜产进出口集团有限公司	20%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

姚文平先生,董事长,硕士。现任德邦证券有限责任公司总裁,中国证券业协会人力资源委员会副主任,上海新金融研究院创始理事。曾在南京大学任教,曾任华泰证券有限责任公司研究所首席研究员,东海证券有限责任公司副总裁。

林燕女士,董事,博士。现任德邦证券有限责任公司副总裁兼财务总监,历任香港荷兰银行高级经理、加拿大ASSANTE Advisory Services财务总监、大鹏证券有限责任公司助理财务总监。

董振东先生,董事,硕士。现任西子联合控股有限公司战略投资部长。曾任中国银行江苏省分行担任计划部职员,新利软件集团股份有限公司担任投资部副总监,浙江国信创业投资有限公司高级经理,杭州锅炉集团股份有限公司证券事务代表。

骆敏华女士,董事,学士。审计师,高级会计师。现任浙江省国际贸易集团有限公司纪委委员、部门经理。

易强先生,董事,硕士,曾任金元比联基金管理有限公司总经理,招商基金管理有限公司业务发展部副总监,比利时联合资产管理有限公司中国地区业务发展总监,比利时联合资产管理有限公司上海代表处首席代表。

吕红兵先生,独立董事,硕士。现任上海市万国律师事务所主任,上海律协副会长,全国律协理事,上海仲裁委员会仲裁员。

刘少波先生,独立董事,博士。现任暨南大学社会科学研究处处长、金融研究所所长。广东经济学会副会长、广东股份经济与证券市场研究会副会长兼秘书长、广东房地产业协会常务理事、广东证券业协会顾问、广东省科技风险投资公司特聘专家、广东省政府WTO事务咨询理事会理事。

安同良先生,独立董事,博士。南京大学商学院经济学系主任,中国生产力学会理事、中国技术经济研究会理事。

2、基金管理人监事会成员

胡宝发先生,监事会主席,学士。现任德邦证券有限责任公司财务管理部总经理。曾任职于国联证券漕宝路营业部、国联证券邯郸路营业部。

陈飞先生,监事,硕士。现任职于浙江省国际贸易有限公司投资部,曾任职于浙江东方集团股份有限公司财务部工作。

高继萍女士,职工监事,学士。曾先后在建设银行深圳信托上海证券业务部、天同证券有限责任公司、群益证券上海代表处、光大保德信基金管理有限公司任职。

霍寅先生,监事,硕士 ,曾在金元比联基金管理有限公司担任整合营销部副总监。并曾任职于招商银行,平安集团,德邦证券有限责任公司,汇添富基金管理有限公司。

3、公司高管人员

姚文平先生,董事长,硕士。(简历请参见上述董事会成员介绍)

易强先生,总经理,硕士。(简历请参见上述董事会成员介绍)

易强先生,代督察长,硕士。(简历请参见上述董事会成员介绍)

白仲光先生,副总经理,投资总监,博士,曾任长盛基金管理有限公司研究员、高级金融工程师、金融工程部及量化投资部总监、公司投资决策委员会成员,2006年至2011年期间担任长盛中证100指数证券投资基金基金经理。具有8年以上证券投资管理经历。

4、本基金现任基金经理

何晶先生,哥伦比亚大学硕士。曾任职江海证券数量分析,东证期货数量研究员、TNT数据库分析师、奥瑞高市场研究公司市场研究员。具有3年以上证券投资管理经历,未出现法律法规规定不得担任基金经理的情形。2013年4月25日至今任本基金基金经理。

侯慧娣女士,云南大学硕士研究生,3年金融行业从业经验,目前兼任固定收益研究。曾任世商软件(上海)有限公司从事债券投资组合风险量化分析、利率互换定价研究、债券估值定价分析工具研究等;国信证券股份有限公司经济研究所从事固定收益分析。2013年8月29日至今任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

易强先生,总经理;
白仲光先生,副总经理、投资总监;
高继萍女士,交易部总监;
叶翔先生,研究发展部副总监;
何晶先生,金融工程研究员。

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、依法募集基金,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、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、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)基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺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;

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)将基金管理人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)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;

4、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;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

(五)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、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六)基金管理人的内部控制制度

1、基金管理人内部控制原则

健全性原则:内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节;

有效性原则:通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行;

独立性原则:公司各机构、部门和岗位职责上保持相对独立。公司受托资产、自有资产、其他资产的运作应当分离;

相互制约原则:公司各部门和岗位的设置应当职权分明,相互制衡;

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。

2、基金管理人内部控制的主要内容

(1)控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础,包括经营理念、内控文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

公司应坚守诚信原则,树立内控优先的思想和风险管理理念,培养全体员工的风险防范意识,营造一个浓厚的内控文化氛围,保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

公司应建立健全法人治理结构,确定公司股东会、董事会、监事会和督察长的职责权限;明确董事会的组成结构和决策程序,充分发挥独立董事在公司治理中的作用;建立监督制约机制,充分发挥监事会的监督职能;严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,保护投资人利益和公司的合法权益。

公司应依照职责明确、相互制约的原则设置运作高效又互相制衡的内部组织架构,各部门授权分工明确,操作相互独立。

公司应建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制,包括民主、透明的决策程序和管理议事规则;高效、严谨的业务执行系统;以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

公司应建立有效的人力资源管理制度,健全激励约束机制,确保公司人员具备和保持与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

公司应设计和维护畅通的信息沟通渠道,建立清晰的报告系统。

(2)风险评估

公司应当建立科学严密的风险评估体系,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,及时防范和化解风险。

公司应定期和不定期对风险和内部控制进行评估,做好事前、事中和事后的风险管理,并根据市场环境、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。

(3)控制体系

① 内部控制机制

公司应当依据自身经营特点,设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线,涵盖决策、执行、监督三个层面。

决策层面:由股东会、董事会及下设专门委员会构成,专事负责公司经营管理、受托投资等重大事项的决策;

执行层面:由经理层及下设的投资决策委员会、风险控制委员会等专业委员会和公司各部门组成,负责落实决策层制定的战略部署;

监督层面:由监事会、督察长和稽核监察部门等组成,承担监督和管理职责,确保公司经营管理、受托投资、员工行为等符合有关法律法规和公司各项规章制度。

② 内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和具体部门规章等部分组成。

建立完善的资产分离制度,受托资产与公司资产、不同受托资产之间应独立运作,分别核算。

建立科学、严格的岗位分离制度,明确划分各岗位职责,重要岗位不得有人员的重叠。重要业务部门和岗位应进行物理隔离。

建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,相关部门和岗位之间相互监督制衡。

制定切实可行的紧急应变制度,建立危机处理机制和程序。以达到快速、及时、有效化解危机的目的,减少危机造成的损失,降低不利影响,最大限度地保护投资人利益,维护公司合法权益。

公司应建立明确的授权制度,并将其贯穿于公司经营活动的始终。

A.股东会、董事会、监事会和经理层应当充分了解和履行各自的职权,建立健全的公司授权标准和程序,确保授权制度的贯彻执行;

B.公司各部门、分支机构和公司员工在其规定的授权范围内行使相应的职责;

C.公司重大业务的授权应当采取书面形式,授权书须明确授权内容及时效;

D.公司授权要适当,对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制,对已不适用的授权应及时修改或取消。

(3)控制活动

控制活动主要包括投资管理业务控制、运营管理业务控制、销售业务控制、信息披露控制、会计系统控制、监察稽核控制等。

公司应当自觉遵守有关法律法规和行业监管规则,按照经营管理和受托投资的性质、特点,严格制定各项制度、规章、操作流程和岗位手册,明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

3、基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

(2)上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3)本公司承诺将根据市场环境变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

二、 基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:牛锡明
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:裴学敏
电话:021-95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市,是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。交通银行连续五年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强,营业收入排名第243位,较上年提升83位;列《银行家》杂志全球1,000家最大银行一级资本排名第23位,较上年提升7位。截至2013年6月30日,交通银行资产总额达到人民币5.71万亿元,实现净利润人民币347.82亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

牛锡明先生,交通银行董事长,哈尔滨工业大学经济学硕士,高级经济师。2009年12月起担任交通银行行长,2013年5月起担任交通银行董事长。

钱文挥先生,交通银行副行长,上海财经大学工商管理硕士。2004年10月起任交通银行副行长,2007年8月起任交通银行执行董事。

刘树军先生,交通银行资产托管部总经理。管理学硕士,高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长,农行总行托管部及养老金中心副总经理,交通银行内蒙古分行副行长。2011年10月起任交通银行资产托管部副总经理,2012年5月起任交通银行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止2013年三季度末,交通银行共托管证券投资基金95只,包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面200ETF、博时深证基本面200ETF联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证500指数、建信深证100指数、富安达策略精选混合、金鹰中证500指数分级、工银瑞信纯债定期开放债券、富安达收益增强债券、易方达恒生中国企业ETF、易方达恒生中国企业ETF联接、光大保德信添盛双月债券、浦银安盛幸福回报债券、浙商聚盈信用债债券、德邦优化配置股票、汇添富理财28天债券、金鹰元泰精选信用债债券、诺安中小板等权重ETF、诺安中小板等权重ETF联接、中邮稳定收益债券、富安达现金通货币、东吴内需增长混合、建信优势动力股票(LOF)、浦银安盛新兴产业混合、农银高增长股票、建信央视财经50指数分级、工银安心增利场内货币、易方达保证金货币、东吴鼎利分级债券、德邦德信中高企债指数分级、天治可转债、华安双债添利债券、工银信用纯债两年定开债券、农银行业领先股票、嘉实丰益策略定期开放债券、工银瑞信月月薪债券、国联安中证医药100指数、上投摩根岁岁盈定期开放债券、方正富邦互利定期开放债券、建信周盈安心理财债券。此外,还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品。

三、 相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)德邦基金管理有限公司上海直销中心
办公地址:上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层
联系人:高蔚如
电话:021-26010999
直销电话:021-26010928
直销传真:021-26010960
客服热线:400-821-7788
网址:www.dbfund.com.cn

(2)德邦基金管理有限公司网上交易系统
网址:www.dbfund.com.cn

2、场外代销机构

(1)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系人:曹榕
电话:021-58781234
传真:021-58408440
客服电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com

(2)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:唐苑
电话:021-61618888
传真:021-63604199
客服电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

(3)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址::北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客服电话:95568
联系人:杨成茜
电话:010-57092619
传真:010-57092611
网址:www.cmbc.com.cn

(4)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:范一飞
联系人:夏雪
电话:021-68475888
传真:021-68476111
客服电话:021-962888
公司网址:www.bankofshanghai.com

(5)德邦证券有限责任公司
注册地址:普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
联系人:徐可
电话:021-68761616
传真:021-68767032
客服电话:400-8888-126
公司网址:www.tebon.com.cn

(6)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:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号 民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:焦琳
电话:010-85189120-8023
传真:010-85189120-8017
客服电话:400-888-6661
公司网址:www.myfund.com

(7)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海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:周嬿旻
电话:(0571)28829790,(021)60897869
传真:(0571)266698533
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(8)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021-58787698
客服电话:400-089-1289
公司网址:www.erichfund.com

(9)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
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
联系人:张茹
电话:021-58870011
传真:021-68596919
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

3、场内发售机构

本基金通过深圳证券交易所上网定价发售,基金份额发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。

(1)已经具有基金代销业务资格的深交所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。

(2)本基金募集期间获得基金代销资格并具有深交所会员单位资格的证券公司经深交所确认后也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。

(3)尚未取得基金代销资格,但属于深交所会员的其他机构,可在本基金上市交易后,代理投资人通过深交所交易系统参与本基金的买卖。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
联系电话:010-59378839
联系人:010-59378907

(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
注册地址:上海市银城中路68号19楼
办公地址:上海市银城中路68号19楼
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所
法定代表人:葛明
住所:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
公司电话:010-58153000
公司传真:010-85188298
签章会计师:徐艳、蓦周
业务联系人:徐艳

四、 基金的名称

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金

五、 基金的类型

契约开放式,债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金为债券型指数证券投资基金,通过数量化的风险管理手段优选指数成份券、备选成分券及样本外债券,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪误差的最小化。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为主要投资于债券,包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购以及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)。此外,本基金也可投资于银行定期存款、通知存款、大额存单等具有良好流动性的货币市场工具。本基金不投资股票(含一级市场新股申购)、权证和可转换公司债券(不含可分离交易可转债的纯债部分)。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产净值的90%。其中,投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于债券资产净值的80%。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于中国证监会允许基金投资的其他金融工具。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具或金融衍生工具,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

本基金主要采取抽样复制法构建基金债券投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应的调整。在正常市场情况下,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过5%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

本基金将不低于基金资产净值的90%投资于债券资产,又将不低于债券资产净值的80%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好,收益较高的固定收益类产品,以保证投资组合能够跟踪指数的基础上,具有较好的流动性。并且基金管理人在履行相应程序后可以投资相关法律法规允许的金融衍生工具,以更好得实现基金的投资目标。

2、债券投资策略

为实现跟踪标的指数的投资目标,本基金将在"久期盯住""信用等级结构盯住"等标准的基础上,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况,投资于标的指数中具有代表性的部分成份券、备选成份券,或灵活选取关键特征类似的替代券构建投资组合,使得债券投资组合的总体特征(如久期、信用等级结构和到期收益率等)与标的指数相似,以保证对标的指数的有效跟踪。灵活优选关键特征类似的替代券是当对标的指数走势影响较大的成分券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成分券交易量不符合市场交易惯例时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,本基金会根据市场情况,结合经验判断,选取关键特征与相关成分券类似的替代券或替代券组合进行替代,以适当变通和调整。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响,本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。

3、债券回购策略

利用债券资产可作为抵押物进行回购融入资金的特点,运用回购策略以更紧密的跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征,以便更好地实现基金的投资目标。

4、未来,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在依法履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围,并更新和丰富基金投资策略。

九、基金的业绩比较基准

中证1-7年中高收益企债指数×90%+银行活期存款利率(税后)×10%

十、基金的风险收益特征

从整体运作来看,基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

从两类份额看,德信A份额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率+1.20%,表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。德信B份额获得剩余收益,带有适当的杠杆效应,表现出预期风险较高,预期收益相对较高的特点。

十一、基金投资组合报告

本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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2013年9月30日,本报告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	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	346,575,106.39	77.07
	其中:债券	346,575,106.39	77.07
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	49,715,514.58	11.06
	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	42,958,646.28	9.55
7	其他各项资产	10,438,708.45	2.32
8	合计	449,687,975.70	100.00

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

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	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	346,575,106.39	78.07
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	346,575,106.39	78.07

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	124043	12深立业	255,250	25,471,397.50	5.74
2	122988	09渝隆债	200,000	20,800,000.00	4.69
3	122132	12鹏博债	200,000	20,780,000.00	4.68
4	1280336	12娄底债	200,000	20,408,000.00	4.60
5	1280452	12长沙先导债	200,000	20,276,000.00	4.57

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10、投资组合报告附注

(1)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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本基金本报告期末未持有股票。

(3)期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,068.31
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,388,059.19
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	38,580.95
8	其他	–
9	合计	10,438,708.45

(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

本报告中因四舍五入原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

十二、 基金的业绩

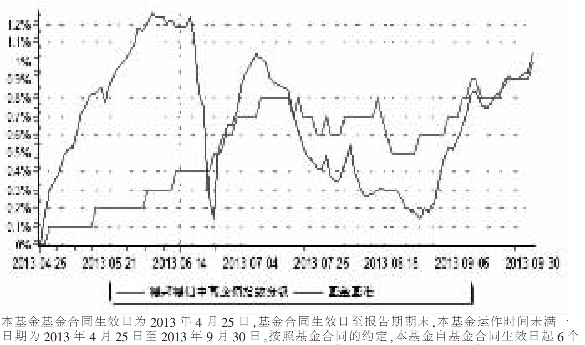
基金业绩截止日为2013年9月30日,并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、本基金合同生效日为2013年4月25,基金合同生效以来(截至2013年9月30日)历史各时间段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:

期间	①份额净值增长率	②份额净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2013年4月25日-2013年6月30日	0.60%	0.04%	0.66%	0.12%	-0.06%	-008%
2013年7月1日-2013年9月30日	0.40%	0.06%	0.40%	0.06%	0.00%	0.00%
2013年4月25日-2013年9月30日	1.00%	0.05%	1.06%	0.09%	-0.06%	-0.04%

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:



注:本基金基金合同生效日为2013年4月25日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2013年4月25日至2013年9月30日。按照基金合同的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

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、标的指数使用许可费;
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、基金上市费;
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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.70 %÷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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷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、公休日等,支付日期顺延。

3、标的指数使用许可费

指数使用许可费根据基金管理人与指数开发商签署的相关许可协议确定并调整。在通常情况下,指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.015%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.015%÷当年天数
H为每日应计提的指数使用许可费,E为前一日的基金资产净值。

指数使用许可费每日计提,按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元,基金设立当年,不足三个月的,按照三个月收费。

基金管理人可根据指数许可协议规定的费率、收费方式变更和基金份额持有人的利益,对上述计提方式进行合理变更并公告。

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)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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《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,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:

1、在"重要提示"部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、更新了"第三部分 基金管理人"中基金管理人的相关信息。
3、更新了"第四部分 基金托管人"中基金托管人的相关信息。
4、更新了"第五部分 相关服务机构"中代销机构信息。
5、更新了"第七部分 基金的募集"中基金募集的信息。
6、更新了"第八部分 基金合同的生效"中的相关信息,本基金合同于2013年4月25日生效。
7、更新了"第九部分德信A份额与德信B份额的上市交易"中德信A份额与德信B份额的上市交易时间。
8、更新了"第十部分 德邦德信基金份额的申购与赎回"中开始办理德邦德信基金份额的申购和赎回业务的时间。
9、更新了"第十一部分 基金的份额配对转换"中开通基金份额配对转换业务的时间。
10、更新了"第十二部分 基金的投资"中基金投资组合报告内容。
11、增加了"第十三部分 基金的业绩",说明了自2013年4月25本基金合同生效日至2013年9月30日的基金业绩。
12、更新了"第二十五部分 托管协议的内容摘要"中托管人的法定代表人及注册资本信息。
13、更新了"第二十七部分 其他应披露事项",列示了本基金自2013年4月25日至2013年10月25日涉及本基金的信息披露事项。

德邦基金管理有限公司
二〇一三年十二月六日

证券代码:600520 证券简称:中发科技 公告编号:临2013—042

铜陵中发三佳科技股份有限公司2013年度第三次临时股东大会决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

重要内容提示:

?本次会议是否有否决提案的情况:否

?本次会议召开前是否存在补充提案的情况:否

?本次股东大会是否有变更前次股东大会决议的情况:否

一、会议召开及出席情况

(一)介绍股东大会召开的时间和地点

召开时间:2013年12月5日(星期四)上午9:00时

召开地点:安徽省铜陵市石城路电子工业园铜陵中发三佳科技股份有限公司办公楼四楼会议室

(二)出席会议的股东和代理人人数,所持有表决权的股份总数及占公司有表决权股份总数的比例:

出席会议的股东和代理人人数	5人
所持有表决权的股份总数(股)	27075133股
占公司有表决权股份总数的比例(%)	23.9518

(三)表决方式:

采取现场投票的方式表决,符合《公司法》及《公司章程》的规定,本次会议由公司副董事长陈迎志先生主持。

(四)公司董事、监事和董事会秘书的出席情况:

公司在任董事9人,出席5人,董事黄言勇、陈邓华、朱胜登、侯忠云等四名董事均因出差未能出席本次股东大会。

公司在任监事5人,出席2人,监事陈余江、施剑文、张挺峰因出差未能出席本次股东大会。

公司董事会秘书申立丰、财务总监柳飞列席了会议。

二、提案审议情况

序号	议案内容	同意票数	同意比例	反对票数	反对比例	弃权票数	弃权比例	是否通过
1	《关于同意控股子公司安徽中智光源科技有限公司向中国银行铜陵分行申请9000万元综合贷款授信的议案》	27075033票	99.9996%	0票	0	100票	0.0004%	是
2	《关于为控股子公司安徽中智光源科技有限公司综合贷款授信9000万元提供担保的议案》	27075033票	99.9996%	0票	0	100票	0.0004%	是

三、律师见证情况

安徽承义律师事务所鲍金桥律师、束晓俊律师见证了本次股东大会,并就本次股东大会出具了《法律意见书》。该法律意见书认为:本次股东大会的召集人资格和召集、召开程序、出席会议人员的资格、提案、表决程序和表决结果均符合法律、法规、规范性文件和公司章程的规定;本次股东大会通过的有关决议合法有效。

四、备查文件目录

(一)公司董事签字确认的中发科技2013年度第三次临时股东大会决议;

(二)公司2013年度第三次临时股东大会会议记录;

(三)安徽承义律师事务所出具的《关于铜陵中发三佳科技股份有限公司召开2013年度第三次临时股东大会的法律意见书》;

(四)公司2013年度第三次临时股东大会会议资料。

特此公告。

铜陵中发三佳科技股份有限公司
董事会
二〇一三年十二月五日

中银中高等级债券型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2013年12月6日

1.公告基本信息

基金名称	中银中高等级债券型证券投资基金
基金简称	中银中高等级债券
基金主代码	000305
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月5日
基金管理人名称	中银基金管理有限公司
基金托管人名称	中国民生银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《中银中高等级债券型证券投资基金基金合同》以及《中银中高等级债券型证券投资基金招募说明书》等

2.基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		证监许可[2013]1021号
基金募集期间		自2013年11月7日 至2013年12月3日止
验资机构名称		安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
募集资金划入基金托管专户的日期		2013年12月5日
募集有效认购总户数(单位:户)		956
募集期间净认购金额(单位:人民币元)		1,363,269,447.17
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)		77,717.90
募集份额(单位:份)	有效认购份额	1,363,269,447.17
	利息结转的份额	77,717.90
	合计	1,363,347,165.07
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	–
	占基金总份额比例	–
	其他需要说明的事项	–
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	995.07
	占基金总份额比例	0.0001%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2013年12月5日

注:1、本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0,本基金的基金经理持有本基金份额总量的区间为0。

2、本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由本基金管理人承担,不从基金资产中支付。

3.其他需要提示的事项

1)基金份额持有人可以到基金销售机构的网点进行交易确认单的查询和打印,也可以通过本基金管理人的网站(www.bocim.com)或客户服务电话(400-888-5566)查询交易确认情况。

2)基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

风险提示:基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。投资者投资本基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司
2013年12月6日

股票代码:600732 股票简称:上海新梅 编号:临2013-056

上海新梅置业股份有限公司 重大事项继续停牌公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

因本公司正在筹划涉及非主营业务资产收购的重大事项,公司已申请了本公司股票自2013年11月29日起连续停牌。

截至本公告发布日,公司与交易对方就相关事项的具体方案尚在讨论中,此事项尚存在不确定性,且不确定是否构成重大资产重组,为维护投资者利益,保证公平信息披露,避免造成公司股价异常波动,经申请,公司股票将继续停牌。

公司将尽快确定是否进行上述重大事项及该事项是否构成重大资产重组,如在5个交易日内无法确定前述事项,公司将予以公告并申请股票于2013年12月13日复牌。

特此公告。

上海新梅置业股份有限公司
董 事 会
2013年12月6日

股票简称:西部证券 股票代码:002673 编号:2013-082

西部证券股份有限公司 2013年11月主要财务信息公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据中国证监会《关于加强上市证券公司监管的规定》(2010年修订),现公告本公司2013年11月主要财务信息。

提请关注事项如下:

1、披露范围:主要包括西部证券母公司当期营业收入、当期净利润、期末净资产等数据。

2、相关数据未经审计,且为非合并数据,最终数据以公司定期报告为准。

西部证券2013年11月主要财务数据表(未经审计)

单位:万元

2013年11月		2013年11月30日
营业收入	净利润	净资产
7,498.67	1,913.37	467,324.17

西部证券股份有限公司董事会
2013年12月5日

证券代码:002640 证券简称:百圆裤业 公告编号:2013-043

山西百圆裤业连锁经营股份有限公司 股票交易异常波动停牌自查公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

因山西百圆裤业连锁经营股份有限公司(以下简称"公司",证券简称"百圆裤业",股票代码002640)股票近期波动幅度较大,公司将对股票异动的事项进行核查,公司股票自2013年12月6日开市起停牌,待公司完成相关核查工作并披露相关公告后复牌。请广大投资者理性投资,注意投资风险。

特此公告。

山西百圆裤业连锁经营股份有限公司
董
事会
二〇一三年十二月五日

证券代码:600239 证券简称:云南城投 公告编号:临2013-075号

云南城投置业股份有限公司 关于公司下属公司竞得土地使用权的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

近日,云南城投置业股份有限公司下属公司云南温泉山谷房地产开发(集团)有限公司竞得土地使用权,现将相关情况公告如下:

序号	地块编号	土地位置	面积(平方米)	成交金额(元)	土地用途	规划设计条件			出让年限(年)
						容积率	建筑密度(%)	绿地率(%)	
1	AN-J2011W009-A2	安宁市温泉街道办事处	45086.28	74,390,000.00	城镇住宅用地	>1.0≤1.2	≤35	≥40	70

特此公告。

云南城投置业股份有限公司
董事会
2013年12月6日