兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2018年第1号）

【本基金不向个人投资者公开发售】
基金管理人：兴业基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经2017年11月10日中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2029号文准予募集注册，基金合同于2017年12月29日正式生效。

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，投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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，本基金的特定风险等等。本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险的基金品种，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。本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%，本基金不向个人投资者销售。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。

本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券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券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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。

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。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2018年6月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人情况

名称：兴业基金管理有限公司
住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址：上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼
法定代表人：卓新章
设立日期：2013年4月17日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]288号
组织形式：有限责任公司
注册资本：12亿元人民币
存续期限：持续经营
联系电话：021－22211888
联系人：郭玲燕
股权结构：

股东名称	出资比例
兴业银行股份有限公司	90%
中海集团投资有限公司	10%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

卓新章先生，董事长，本科学历。曾任兴业银行宁德分行副行长、行长，兴业银行总行信贷审查部总经理，兴业银行福州分行副行长，兴业银行济南分行行长，兴业银行基金业务筹建工作小组负责人，兴业银行总行基金金融部总经理，兴业银行总行资产管理部总经理、兴业银行金融市场总部副总裁等职。现任兴业基金管理有限公司董事长，兴业财富资产管理有限公司执行董事。

明东先生，董事，硕士学位。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输（集团）总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作，历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表，中国远洋运输（集团）总公司／中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总经理、党委委员，中海集团投资有限公司总经理。

汤夕生先生，董事，硕士学位。曾任建设银行浦东分行办公室负责人，兴业银行上海分行南市支行行长，兴业银行上海分行副行长等职。现任兴业基金管理有限公司总经理，兼任上海市基金同业公会第三届副会长。

朱利民先生，独立董事，硕士学位。曾任国家体改委试点司主任科员、副处长、处长，国家体改委下属中华股份制咨询公司副总经理，中国证监会稽查局副局长、中国证监会派出机构工作协调部主任、兼投资者教育办公室主任，中信建投证券股份有限公司合规总监、监事会主席等职。

黄泽民先生，独立董事，博士学位。曾任华东师范大学商学院院长，第十届、十一届、十二届全国政协委员等职。现任华东师范大学终身教授、博导、国际金融研究所所长，兼任上海世界经济学会副会长，中国金融学会学术委员，中国国际金融学会理事，中国国际经济关系学会常务理事，全国日本经济学会副会长，上海市人民政府参事。

曹和平先生，独立董事，博士学位。曾任中共中央书记处农研室国务院农村发展研究中心农业部研究室副主任，北京大学经济学院副院长，云南大学副校长，北京大学供应链研究中心主任，北京大学中国都市经济研究基地首席专家等职。现任北京大学经济学院教授（博士生导师），北京大学环境、资源与发展经济学创系主任，兼任北京大学数字中国研究院副院长，中国经济规律研究会副会长，中国西部促进会副会长，中国环境科学学会绿色金融分会主任，中央电视台财经频道评论员，北京大学供应链研究中心顾问，互联网普惠金融研究院院长，广州市、西安市、哈尔滨市、厦门市、广安市和青岛市金融咨询决策专家委员，云南省政府经济顾问。

2、监事会成员

顾卫平先生，监事会主席，硕士学位。曾任上海农学院农业经济系金融教研室主任、系副主任，兴业银行上海分行副行长，兴业银行天津分行行长，兴业银行广州分行行长等职。现任兴业银行总行资产管理部总经理。

杜海英女士，监事，硕士学位。曾任中海（海南）海盛船务股份有限公司发展部科长、发展部副主任（主持工作）、发展部主任，中共中国海运（集团）总公司党校副校长，集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董事长。

李骏先生，职工监事，硕士学位。曾任渣打银行全球金融市场部主任，海富通基金管理有限公司机构业务部副总经理，兴业基金管理有限公司综合管理部副总经理。现任兴业基金管理有限公司产品研发部总经理。

赵正义女士，职工监事，硕士学位。曾任上海上会会计师事务所审计员，生命人寿保险股份有限公司稽核审计部助理总经理，海富通基金管理有限公司监察稽核部稽核经理、财务部高级财务经理，兴业基金管理有限公司监察稽核部副总经理。现任兴业基金管理有限公司财富管理总部副总经理。

3、公司高级管理人员

卓新章先生，董事长，简历同上。

汤夕生先生，总经理，简历同上。

王薏女士，督察长，本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理，兴业银行广州分行副行长，兴业银行信用审查部总经理，兴业银行小企业部总经理，兴业银行金融市场总部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生，副总经理，硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长，兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理，兴业银行厦门分行党委委员、行长助理，兴业银行总行投资银行部副总经理，兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张顺国先生，副总经理，本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理，深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理、商人银行部副总经理，深圳发展银行上海分行宝山支行副行长，兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理，兴业基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理，上海兴晟股权投资管理有限公司总经理，兴投（平潭）资本管理有限公司执行董事。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

庄孝强先生，总经理助理，本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经理，兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长，兴业银行总行资产管理部总经理助理，兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理，兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

4、本基金基金经理

莫华寅先生，硕士学位，特许金融分析师（CFA）。10年证券从业经历。2008年7月至2011年8月在中银基金管理有限公司从事渠道销售相关工作；2011年8月至2012年8月在东吴证券股份有限公司固定收益总部担任高级交易员，从事债券交易工作；2012年9月至2015年8月在浙商基金管理有限公司固定收益部先后担任债券研究员、专户投资经理、基金经理，其中2014年9月至2015年8月担任浙商聚盈信用债债券型证券投资基金基金经理，2015年4月至2015年8月担任浙商聚潮新思维混合型证券投资基金基金经理，2015年5月至2015年8月担任浙商聚潮策略配置混合型证券投资基金基金经理。2015年8月加入兴业基金管理有限公司，2016年12月16日起担任兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金的基金经理，2017年12月29日起担任兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年3月2日起担任兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

5、投资策略委员会成员

汤夕生先生，总经理。
黄文锋先生，副总经理。
周鸣女士，固定收益投资一部投资总监。
冯小波先生，固定收益投资二部总经理。
徐莹女士，固定收益投资二部副总经理兼投资总监。
腊博先生，固定收益投资一部投资总监。
陈子越先生，研究部总经理助理兼海外投资部（筹）投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：陈四清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于"SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）名称：兴业基金管理有限公司直销中心
住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
法定代表人：卓新章
办公地址：上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼
联系人：张聆枫
电话：021-22211885
传真：021-22211997
网址：http://www.cib-fund.com.cn

2、其他销售机构

其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

（二）登记机构

名称：兴业基金管理有限公司
住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址：上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼
法定代表人：卓新章
设立日期：2013年4月17日
联系电话：021-22211899
联系人：金晨

（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
办公场所：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：陈颖华
经办律师：黎明、陈颖华

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
主要经营场所：上海市延安东路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人：曾顺福
电话：021-6141 8888
传真：021-6335 0177/0377
联系人：曾浩
经办注册会计师：曾浩、吴凌志

四、基金的名称

兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金份额的封闭期和开放期

（一）基金的封闭期

本基金封闭期为自基金合同生效日起（包括该日）3个月或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）3个月的期间。本基金封闭期内采取封闭运作模式，不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起（包括该日）至3个月后的月度对日的前一日止。首个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入首个开放期，第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至3个月后的月度对日的前一日止，以此类推。

（二）基金的开放期

本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。开放期间为5至20个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在每一开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。

比如，假设本基金的《基金合同》于2016年12月29日生效，则本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为3个月后的月度对日的前一日止，2016年12月29日3个月后的月度对日为2017年3月29日，即本基金的第一个封闭期为2016年12月29日至2017年3月28日；首个封闭期结束之后的第一个工作日为2017年3月29日，从该日开始进入首个开放期，假设首个开放期为10个工作日，则首个开放期自2017年3月29日至2017年4月12日；第二个封闭期的起始之日为首个开放期结束之日次日，即第二个封闭期的起始之日为2017年4月14日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的3个月后的月度对日的前一日，即第二个封闭期为2017年4月14日至2017年7月13日，以此类推。

七、基金的投资目标

在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围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、中期票据、资产支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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。

本基金不参与股票或权证的投资。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

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%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前10个工作日至开放期结束后10个工作日内，基金投资不受前述比例限制。开放期内，基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，基金不受上述5%的限制。

九、基金的投资策略

（一）基金的投资策略

本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

1、封闭期投资策略

（1）资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策等情况的研究，把握大类资产的预期收益率、利差水平、风险水平，在有效控制风险的基础上，动态调整基金大类资产的投资比例，力争为基金资产获取稳健回报。

（2）久期策略

本基金将通过宏观经济变量和宏观经济政策等进行定性及定量分析，在考虑封闭期剩余期限的基础上，进而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。当预期市场利率将上升时，适当降低组合的久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

（3）信用债券投资策略

信用类债券是本基金重要投资标的，信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本基金将根据宏观经济运行状况、行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险，确定信用类债券的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。同时，本基金将运用本基金管理人比较完善的信用债券评级体系，对信用债券发行人基本面的深入调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

（4）类属配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，债券资产有必要配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。本基金将综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的结果决定投资组合的类别资产配置策略。

（5）个券选择策略

本基金根据债券市场收益率水平，在综合考虑债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素的基础上，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在确定债券组合久期之后，本基金将通过对不同信用类别债券收益率基差分析，结合税收差异、信用风险分析、利差分析以及交易所流动性分析，判断个券的投资价值，以挑选风险收益相匹配的券种，建立具体的个券组合。

（6）杠杆投资策略

本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。

（7）资产支持证券的投资策略

本基金将在综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素的基础上，对资产证券化产品的收益和风险匹配情况等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。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。

（8）中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，着重分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。

2、开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。

（二）基金的投资管理流程

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；
（2）以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；
（3）国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

（1）备选库的形成与维护

对于债券投资，分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，采用利率模型、信用风险模型及期权调整利差（OAS）对普通债券和含权债券进行分析，在此基础上形成基金债券投资的信用债备选库。

（2）资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合以及个股配置，形成资产配置建议。

（3）构建投资组合

投资策略委员会在基金合同规定的投资框架下，审议并确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资策略委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投研会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

（4）交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（5）投资组合监控与调整

基金经理负责向投资策略委员会汇报基金投资执行情况，监察稽核部对基金投资进行日常监督，风险管理总部负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估，对基金投资组合不断进行调整和优化。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中债公司）编制并发布。中债企业债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债的整体价格走势和投资回报情况；中债国债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的记账式国债的整体价格走势和投资回报情况。这两个债券指数具有较好的市场代表性，能够较好的反映我国企业债市场和国债市场的总体走势。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，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。

十一、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较低风险的基金品种，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。

十二、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，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3月31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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	835,478,057.72	63.60
	其中：债券	835,478,057.72	63.60
	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	458,659,431.00	34.91
8	其他资产	19,567,670.93	1.49
9	合计	1,313,705,159.65	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

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(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	119,502,000.00	11.76
	其中：政策性金融债	119,502,000.00	11.76
4	企业债券	549,679,057.72	54.08
5	企业短期融资券	20,108,000.00	1.98
6	中期票据	88,243,000.00	8.68
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	57,946,000.00	5.70
9	其他	-	-
10	合计	835,478,057.72	82.20

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	136421	16春秋01	800,000	78,696,000.00	7.74
2	136713	16康恩贝	800,000	77,872,000.00	7.66
3	112201	14机电01	700,000	71,036,000.00	6.99
4	170205	17国开05	600,000	59,406,000.00	5.84
5	180301	18进出01	500,000	50,085,000.00	4.93

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包含股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	108,703.34
2	应收证券清算款	3,200,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	16,258,967.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	19,567,670.93

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。

十三、基金的业绩

基金业绩截止日为2018年3月31日。

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。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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
自基金合同生效日起至2017年12月31日	0.01%	0.01%	0.02%	0.02%	-0.01%	-0.01%
2018年1月1日至2018年3月31日	1.23%	0.03%	0.60%	0.04%	0.63%	-0.01%
自基金合同生效日起至2018年3月31日	1.24%	0.03%	0.62%	0.03%	0.62%	0.00%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十四、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、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的开户费用和账户维护费；
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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.3%÷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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.1%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管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。

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，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

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。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和／或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至管理人账户并自基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书（更新）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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2017年12月23日刊登的《兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新，并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

1、在"重要提示"部分，补充了基金合同生效时间、招募说明书内容的截止日期以及相关财务数据的截至日期。
2、在"一、绪言"部分，补充了基金合同生效时间。
3、在"三、基金管理人"部分，更新了基金管理人及主要人员情况。
4、在"四、基金托管人"部分，更新了托管人基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况。
5、在"五、相关服务机构"部分，更新了直销联系人的信息。
6、在"六、基金的募集"部分，更新了基金募集情况。
7、在"七、基金合同的生效"部分，更新了基金合同生效情况。
8、在"十、基金的投资"部分，补充了基金投资组合报告的内容。
9、在"十一、基金的业绩"部分，补充了基金业绩表现的内容。
10、在"二十一、基金托管协议的内容摘要"部分，更新了托管协议当事人信息。
11、在"二十三、其他应披露事项"部分，补充了基金管理人在招募说明书更新期间刊登的与本基金相关的公告。

兴业基金管理有限公司
2018年8月11日

证券代码：601326　证券简称：秦港股份　公告编号：2018-022

秦皇岛港股份有限公司
关于首次公开发行部分限售股上市流通的公告

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。

重要内容提示：

- ●本次限售股上市流通数量为1,095,244,796股
- ●本次限售股上市流通日期为2018年8月16日

一、本次限售股上市类型

秦皇岛港股份有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）经中国证券监督管理委员会《关于核准秦皇岛港股份有限公司首次公开发行股票的批复》（证监许可[2017]1097号）核准，并经上海证券交易所同意，向社会公众首次公开发行人民币普通股（A股）558,000,000股，并于2017年8月16日在上海证券交易所挂牌上市。公司首次公开发行A股股票前的总股本为5,029,412,000股，首次公开发行A股股票后的总股本为5,587,412,000股。

本次上市流通的限售股为公司首次公开发行A股限售股，共涉及9名股东，分别为秦皇岛市人民政府国有资产监督管理委员会（以下简称"秦皇岛市国资委"）、河北建投交通投资有限责任公司（以下简称"河北省交投"）、大秦铁路股份有限公司（以下简称"大秦铁路"）、中国海运集团有限公司（以下简称"中国海运"）、国寿投资控股有限公司（以下简称"国寿投资"）、首钢集团有限公司（以下简称"首钢集团"）、北京控股集团有限公司（以下简称"北控集团"）、大同煤矿集团有限责任公司（以下简称"同煤集团"）、全国社会保障基金理事会转持一户（以下简称"全国社保基金"）。上述股东所持公司首次公开发行前股份的锁定期为自公司股票上市之日起十二个月，现锁定期即将届满，该部分限售股共计1,095,244,796股，将于2018年8月16日起上市流通。

二、本次限售股形成后至今公司股本数量变化情况

公司首次公开发行A股股票完成后，总股本为5,587,412,000股，其中无限售条件流通股为1,387,853,000股，有限售条件流通股为4,199,559,000股。

截至本公告发布之日，公司未发生配股、公积金转增股本等事项，公司的股 本总数未发生变化。

三、本次限售股上市流通的有关承诺

本次解除股份限售的股东做出的有关承诺如下：

（1）本次发行前股东所持股份的限售安排、股东对所持股份自愿锁定的承诺

本公司股东秦皇岛市国资委、河北省交投、大秦铁路、中国海运、国寿投资、首钢集团、北控集团、同煤集团承诺：其所持本公司股票自本公司本次发行之日起十二个月内不转让或者委托他人管理，也不由本公司回购该部分股份。其将遵守中国证监会《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《上海证券交易所上市规则》、《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的相关规定。

根据《境内证券市场转持部分国有股充实全国社会保障基金实施办法》（财企[2009]94号）的有关规定，本公司首次公开发行A股股票并上市时，由本公司国有股东秦皇岛市国资委、河北省交投、大秦铁路、中国海运、国寿投资、首钢集团、北控集团、同煤集团转由全国社会保障基金理事会持有的本公司国有股，全国社会保障基金理事会将继承原国有股东的禁售期义务。

（2）持有公司5%以上内资股股份的股东的减持意向

秦皇岛市国资委承诺：其作为本公司的持股5%以上股东，将严格根据证券监管机构、自律机构及证券交易所等有权部门颁布的相关法律法规及规范性文件的有关规定以及其就持股锁定事项出具的相关承诺执行有关股份限售事项，在证券监管机构、自律机构及证券交易所等有权部门颁布的相关法律法规及规范性文件的有关规定以及其股份锁定承诺规定的限售期内，将不会进行任何违反相关规定及股份锁定承诺的股份减持行为。其将遵守中国证监会《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的相关规定，严格履行减持的各项规定。其未来持续看好本公司以及所处行业的发展前景，愿意长期持有本公司股票；其认为上市即公开发行股份的行为是本公司融资的一种重要手段，而非短期套利的投机行为。因此，其将会在较长一定时期较稳定持有本公司的股份。

其所持有的本公司股份锁定期届满后2年内，在满足以下条件的前提下，可进行减持：自本公司本次发行之日起至就减持股份发布提示性公告之日，其能够及时有效地履行本次发行时公开承诺的各项义务；且在发布减持股份提示性公告前连续20个交易日的本公司股票交易均价高于发行价，其中，前20个交易日本公司股票交易均价计算公式为：减持提示性公告日前20个交易日本公司股票交易均价＝减持提示性公告日前20个交易日本公司股票交易总额／减持提示性公告日前20个交易日发行人股票交易总量。其在所持股份锁定期满后的2年内，每年减持股份总数不超过其持有的本公司股份总数的50%。若减持当年本公司出现公积金或未分配利润转增股本的情形，则上一年度末总股本计算基数要相应进行调整。可供减持数量不可累积计算，当年度未减持的数量不可累积至下一年。且减持价格不低于本公司本次发行的股票发行价。如果本公司上市后因利润分配、资本公积金转增股本、增发、配股等原因进行除权、除息的，则按照证券交易所的有关规定作除权除息处理。

持股锁定期满后，其如确定依法减持本公司股份的，应提前三个交易日通过本公司发布减持提示性公告，并在公告中明确减持的数量或区间、减持的执行期限等信息。

截至本公告发布之日，上述股东均严格履行承诺，不存在相关承诺未履行影响本次限售股上市流通的情况。

四、控股股东及其关联方资金占用情况

截至本公告日，公司不存在控股股东及其关联方非经营性占用资金情况。

五、中介机构核查意见

中国国际金融股份有限公司（以下简称"保荐机构"）根据相关法律法规对秦港股份本次限售股份上市流通情况进行了认真核查。经核查，保荐机构认为：

截至本核查意见出具之日，本次申请解除股份限售的股东均严格遵守了首次公开发行股票并上市时做出的股份锁定承诺。公司本次限售股份上市流通相关事项符合《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《上市公司证券发行管理办法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》等相关法律法规和规范性文件的要求。公司对与本次限售股份相关的信息披露真实、准确、完整。

综上，保荐机构同意秦港股份本次申请解除部分股份限售并上市流通事项。

六、本次限售股上市流通情况

本次限售股上市流通数量为1,095,244,796股；

本次限售股上市流通日期为2018年8月16日；

首发限售股上市流通明细清单：

序号	股东名称	持有限售股数量(股)	持有限售股占公司总股本比例	本次上市流通数量(股)	剩余限售股数量(股)
1	秦皇岛市国资委	621,455,485	11.12%	621,455,485	0
2	河北省交投	209,866,757	3.76%	209,866,757	0
3	大秦铁路	42,750,000	0.77%	42,750,000	0
4	中国海运	41,437,588	0.74%	41,437,588	0
5	国寿投资	41,437,588	0.74%	41,437,588	0
6	首钢集团	41,437,588	0.74%	41,437,588	0
7	北控集团	41,437,588	0.74%	41,437,588	0
8	同煤集团	41,437,588	0.74%	41,437,588	0
9	全国社保基金	55,231,976	0.99%	13,984,614	41,247,362
合计		1,136,492,158	20.34%	1,095,244,796	41,247,362

七、股本变动结构表

单位：股		本次上市前	变动数	本次上市后
有限售条件的流通股份	1、国家持有股份	621,455,485	-621,455,485	0
	2、国有法人持有股份	3,522,871,539	-459,804,697	3,063,066,842
	3、其他	55,231,976	-13,984,614	41,247,362
	有限售条件的流通股份合计	4,199,559,000	-1,095,244,796	3,104,314,204
无限售条件的流通股份	A股	558,000,000	1,095,244,796	1,653,244,796
	H股	829,853,000	0	829,853,000
	无限售条件的流通股份合计	1,387,853,000	1,095,244,796	2,483,097,796
股份总额		5,587,412,000	0	5,587,412,000

八、上网公告附件

《中国国际金融股股份有限公司关于秦皇岛股份有限公司首次公开发行部分限售股上市流通的核查意见》。

特此公告。

秦皇岛港股份有限公司
董事会
2018年8月11日

证券代码：002609　证券简称：捷顺科技　公告编号：2018-097

深圳市捷顺科技实业股份有限公司
关于控股子公司完成经营范围变更的公告

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

深圳市捷顺科技实业股份有限公司控股子公司深圳市顺易通信息科技有限公司（以下简称"公司"）因业务发展需要变更了经营范围，并于近日完成了工商变更登记手续，相关登记信息具体如下：

企业名称：深圳市顺易通信息科技有限公司
统一社会信用代码：91440300664162117K
企业类型：有限责任公司
企业住所：深圳市福田区梅林街道龙尾路10号捷顺科技402室
法定代表人：唐健
注册资本：人民币12,500万元
营业期限：2007年7月9日至无固定期限

经营范围：

变更前	变更后
一般经营项目：计算机软硬件的开发、销售、技术咨询、技术服务、技术推广、技术转让；停车场规划、设计；经营广告业务；企业管理咨询；计算机系统服务；市场调查；汽车信息咨询；货物及技术进出口业务。	一般经营项目：计算机软硬件的开发、销售、技术咨询、技术服务、技术推广、技术转让；停车场规划、设计；经营广告业务；企业管理咨询；计算机系统服务；市场调查；汽车信息咨询；货物及技术进出口业务；停车场项目投资(具体项目另行申报)；停车场建设工程(凭资质证书经营)；停车场系统研发。(法律、行政法规、国务院决定禁止的项目除外，限制的项目须取得许可后方可经营) 许可经营项目：机动车停放服务。

除经营范围变更之外，公司《营业执照》的其他登记事项未发生变化。

特此公告。

深圳市捷顺科技实业股份有限公司
董事会
二〇一八年八月十一日

证券代码：600576　证券简称：祥源文化　公告编号：临2018-061

浙江祥源文化股份有限公司
关于股东进行股票质押式回购交易提前购回的公告

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。

2018年8月10日，公司接到股东杭州旗吉投资管理合伙企业（有限合伙）（以下简称"杭州旗吉"）关于将其持有的公司部分限售流通股提前购回的通知。现将有关情况公告如下：

2018年8月9日，杭州旗吉将其于2018年6月15日和2018年6月20日质押给中信证券股份有限公司的3,849,140股限售流通股（占公司股份总数的0.59%）和5,000,000股限售流通股（占公司股份总数的0.77%），分别提前购回了其中1,924,570股（占公司股份总数的0.30%）和2,500,000股（占公司股份总数的0.39%），并已办理完成相关手续。

截止目前，杭州旗吉持有公司股份总计为38,614,043股，占公司总股本的5.96%，其中质押股份为30,189,470股，占公司总股本的4.66%。

特此公告。

浙江祥源文化股份有限公司董事会
2018年8月11日

证券简称：大智慧　证券代码：601519　编号：临2018-095

上海大智慧股份有限公司
风险提示公告

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。

2016年7月26日，公司收到中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《行政处罚决定书》（[2016]88号）。《行政处罚决定书》显示中国证监会对公司违反证券法律法规行为进行了立案调查审理，根据查明的违法事实，中国证监会已对公司及相关责任人作出了行政处罚决定。公司已于2016年7月27日对该重大事项通过中国证监会指定信息披露媒体进行公告（公告编号：临2016-050）。

根据中国证监会《关于改革完善并严格实施上市公司退市制度的若干意见》和上海证券交易所《股票上市规则》的有关规定，尚不能排除公司股票退市风险。请投资者注意风险，理性投资。

特此公告。

上海大智慧股份有限公司
董事会
二〇一八年八月十一日