信诚三得益债券型证券投资基金招募说明书摘要

(2013年第2次更新)

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

本基金于2008年9月27日基金合同正式生效。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2013年9月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人:信诚基金管理有限公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人:张翔燕

成立日期: 2005年9月30日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字[2005]142号

注册资本: 2亿元人民币

电话: (021)6864 9788

联系人: 林军

股权结构:

股 东	出资额(万元人民币)	出资比例(%)
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合 计	20000	100

(二)主要人员情况

1、 基金管理人董事、监事基本情况

张翔燕女士,董事长,硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理,中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理,中信证券股份有限公司副总经济师,中信控股有限责任公司风险管理部总经理。现任中信控股有限责任公司副总裁。

陈一松先生,董事,金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总裁办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书、中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任。现任中信信托有限责任公司总经理。

包学勤先生,董事,研究生。历任招商银行证券业务部出市代表、南方证券有限公司投资银行部总经理助理、国信证券有限公司投资银行二部总经理、中信证券股份有限公司深圳投资银行部总经理、中信信托有限责任公司投资银行二部总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理。

Graham David Mason先生,董事,南非籍,保险精算专业学士。历任南非公募基金投资分析师、南非Norwich公司基金经理、英国保诚集团(南非)执行总裁、现任瀚亚投资执行副董事长。

黄慧敏女士,董事,新加坡籍,经济学学士。历任化旗银行消费金融事业部业务副理、新加坡大华银行业务开发副理、大华资产管理公司营销企划经理、瀚亚投资(新加坡)有限公司营销部主管、瀚亚投资(台湾)有限公司市场总监。现任瀚亚投资(台湾)有限公司总经理。

郑美美女士,董事,新加坡籍,工商管理硕士。历任新加坡金融管理局金融市场发展规划部处长。现任瀚亚投资(新加坡)有限公司督察长。

何德旭先生,独立董事,经济学博士。历任中国科学研究院财贸所处长、研究员等职。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任。

夏执东先生,独立董事,经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华中兴会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所首委会副主席。

杨思群先生,独立董事,经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员,现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

李莹女士,监事会主席,金融学硕士。历任中国建设银行冶浪办事处信贷科长、中国建设银行苏州分行中间业务部总经理助理、北京证券投行华东部一级项目经理、中新苏州工业园区创业投资有限公司投资银行部总经理、苏州工业园区银杏投资管理有限公司副总经理。现任苏州元禾控股有限公司财务总监。

解晓然女士,监事,双学位,历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

2、经营管理层人员情况

王俊锋先生,总经理,工商管理硕士。历任国泰基金管理有限公司市场部副总监、华宝兴业基金管理有限公司市场总监、瑞银环球资产管理(香港)有限公司北京代表处首席代表、瑞银证券有限责任公司资产管理部总监。现任信诚基金管理有限公司总经理,首席执行官。

黄小坚先生,副总经理,经济学硕士。历任申银万国证券公司研究所行业分析师、银华基金管理有限公司行业研究员、投资管理部组合经理、基金经理、华宝兴业基金管理有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司副总经理,首席投资官、股票投资总监,信诚优胜精选股票型证券投资基金基金经理。

桂思毅先生,副总经理,工商管理硕士,历任安达信咨询管理有限公司高级审计员,中乔智威洛迪广告有限公司财务主管,德国德累斯登银行上海分行财务经理,信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官。

林军女士,副总经理,经济学硕士。历任浙江省证券公司投资银行部副总经理、市场总监,西南证券有限责任公司国际业务部总经理,招商基金管理有限公司总经理助理、营销总监,汇添富基金管理有限公司市场总监、副总经理,交银施罗德基金管理有限公司总经理助理、市场总监。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

陈晓婷先生,副总经理,经济学硕士,注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信投资有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司市场监监、首席市场官、首席运营官。现任信诚基金管理公司副总经理、兼任中信信诚资产管理有限公司《信诚基金管理有限公司之子公司》总经理。

3、督察长

唐世春先生,督察长,法学硕士,历任北京天平律师事务所律师;国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管;友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书。现任信诚基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

李小先生,12年证券投资经验。历任宝钢集团财务有限责任公司资金部投资经理、宝钢集团有限公司资产部投资经理、宝岛(香港)资有限公司投资部经理、华宝信托有限责任公司投资经理。2011年4月加入信诚基金管理有限公司,担任投资经理。

5、投资决策委员会成员

黄小坚先生,副总经理,首席投资官,股票投资总监;

王旭巍先生,固定收益总监、副首席投资官;

胡喆女士,研究总监、特定资产投资管理总监;

董毓宾先生,交易总监;

张光成先生,股票投资副总监;

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所: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

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

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

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

联系人:田青

联系电话:(010)6759 5096

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行资产托管计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资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,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。

(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、QFII、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2013年6月30日,中国建设银行已托管311只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《金融时报(伦敦)》授予"中国最佳托管银行",在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为"国内最佳托管银行"奖,并获和讯网2011年度和2012年度"中国"最佳资产托管银行"奖,和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度"最佳基金托管银行"奖。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构:

信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人:张翔燕

电话:(021)6864 9788

联系人:杨雁

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:www.citicprufunds.com.cn或www.xcfunds.com

2.代销机构:

(1)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号楼长安兴融中心

法定代表人:王洪章

电话:010-66275654

传真:010-66275654

联系人:王琳

客服电话:95533

公司网站:www.ccb.com

(2)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:常振明

客服电话:95558

联系人:郭伟

网址:http://bank.ecitic.com

(3)中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:路瑞良

客服电话:95599

网址:www.95599.cn

(4)兴业银行股份有限公司

住所:福州市湖东路154号

办公地址:福州市五一中路元洪大厦25层

法定代表人:高建平

联系人:刘玲

电话:021-52629999

客户服务热线:95561

公司网址:www.cib.com.cn

(5)招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:傅育宁

电话:0755-83198888

传真:0755-83195049

联系人:邓桐鹏

客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(6)华夏银行股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:马旭

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(7)宁波银行股份有限公司

注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人:陆华裕

客户服务统一咨询电话:96528,上海地区:962528

网址:www.nbcb.com.cn

联系人:胡技勋

电话:0574-89068340

传真:0574-87050024

(8)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:牛锦明

电话:021)58781234

传真:021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(9)东莞银行股份有限公司

注册地址:广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址:广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人:廖玉林

客户服务热线:0769-96228

网址:www.dongguanbank.cn

(10)中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号

法定代表人:李国华

联系人:陈春林

客户服务电话:95580

网址:www.psbc.com

(11)中国银行股份有限公司

注册地址:北京西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人:田国立

客服电话:95566

传真:010-66594946

电话:010-66594977

网址:www.boc.cn

(12)广发银行股份有限公司

注册地址:广东省广州市广州市东风东路713号

办公地址:广东省广州市广州市东风东路713号

法定代表人:董建岳

客服电话:400-830-8003

公司网站:www.gdb.com.cn

(13)中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座(邮编:518048)

法定代表人:王东明

联系人:顾凌

电话:0755-23835888、010-60838888

传真:0755-23835861、010-60836029

网址:http://www.cs.ecitic.com

(14)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

办公地址:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

法定代表人:陈有安

联系人:田薇、宋明

联系电话:010-66568450

客户服务电话:4008-888-888

网站:www.chinastock.com.cn

(15)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人:方建华

联系人:芮敏祺

电话:021-38676666

客户服务热线:4008888666

(16)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:林生迎

电话:0755-82960223

传真:0755-82943636

网址:www.newone.com.cn

客服电话:95565、4008888111

(17)中银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:献曙明

联系人:邓寒冰

联系电话:021-33389888

传真:021-33388224

客户服务热线:021-32348223或者4008895523

网址:www.wwg.com.cn

(18)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

开放式基金咨询电话:4008888108

网址:www.csc108.com

(19)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层

法人代表人:何如

联系电话:0755-82130833

基金业务联系人:齐晓燕

联系电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

全国统一客户服务电话:95536

网址: www.guosen.com.cn

(20)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

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-23219100

联系人:李笑鸣

客服电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:www.htsec.com

(21)中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人:沈强

开放式基金咨询电话:0571-95548

开放式基金业务传真:0571-85106383

联系人:周妍

网址:www.bigsun.com.cn

(22)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山苗岭路29号澳柯玛大厦15层(0507室)

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)

法定代表人:杨宝林

联系人:吴忠超

联系电话:0532-85022326

客服电话:0532-96577

网址:www.zxwt.com.cn

(23)中国中投证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层法定代表人:龙增来

联系人:刘权

联系电话:0755-82026521

客服电话:400-600-8008、95532

公司网站:www.china-invs.cn

(24)西藏同信证券有限责任公司

注册地址:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市浦东新区世纪大道118弄东方环球企业园24号楼

法定代表人:贾绍君

电话:021-36537114

传真:021-36538467

联系人:汪商斌

客服电话:400-88111-77

公司网址:www.xzsec.com

(25)东信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

开放式基金咨询电话:4008001001

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82558305

网址:www.essence.com.cn

(26)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

客服电话:4008888788、10108998

联系人:刘晨

联系电话:021-22169999

网址:www.ebscn.com

(27)广发证券股份有限公司

法定代表人:孙树明

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人:黄岚

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

开放式基金业务传真:020)87555305

公司网站:广发证券网 www.gf.com.cn

(28)华福证券有限责任公司

注册地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人:黄金琳

联系人:张腾

联系电话:0591-87383623

业务传真:0591-87383610

统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)

公司网址:www.hfzq.com.cn

(29)齐鲁证券有限公司

注册地址:济南市经十路20518号

办公地址:济南市经七路86号23层

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

联系电话:0531-81283938

传真:0531-81283900

客服电话:95538

公司网址:www.qlzq.com.cn

(30)东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22-29层

法定代表人:潘鑫军

电话:021-63325888-3108

传真:021-63326173

联系人:吴宇

客户服务电话:95503

网址:www.dfzq.com.cn

(31)长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客户服务热线:95579或4008-888-999

联系人:李良

电话:027-65799999

传真:027-85481900

长江证券客户服务网站:www.95579.com

(32)信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:高冠江

联系人:鹿馨方

联系电话:010-63081000

传真:010-63080978

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(33)天相投资顾问有限公司(简称:天相投顾")

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人:林义相

客服电话:010-66045678

联系人:林爽

联系电话:010-66045608

传真:010-66045521

天相投顾网址:http://www.txsec.com

天相基金网网址:http://jijin.txsec.com

(34)华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

客服电话:95597

(35)宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址:北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人:冯戎

客服电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com

(36)平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)

法定代表人:杨宇翔

全国免费业务咨询电话:95511-8

开放式基金业务传真:0755-82400862

全国统一总机:95511-8

联系人:郑舒丽(zhengshuli001@pingan.com.cn,0755-22626391)

网址: www.pingan.com

(37)世纪证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦4042层

法定代表人:卢长才

电话:0755-83199599

传真:0755-83199545

网址:www.csco.com.cn

(38)上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人:其实

电 话:021-54509998

传 真:021-64385308

(39)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:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人:杨文斌

电 话:021-58870011

传 真:021-68596916

(40)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:上海市浦东新区浦东大道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

(41)杭州数米基金销售有限公司

注册地址:浙江省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:周嫣旻

电 话:0571-28829790

传 真:0571-26698533

(42)长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:黄耀华

客服电话:400-6666-888

公司网址:www.cgws.com

(43)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元

办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元

法定代表人:薛峰

电 话:0755-33227950

传 真:0755-82080798

客服热线:4006-788-887

网址: www.zlfund.cn及www.jimmw.com

(44)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人:汪静波

电 话:021-38602377

传 真:021-38509777

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:信诚基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人:张翔燕

联系电话:021- 68649788

传真:021-50120888

联系人:金劳员

(三)相具法律意见书的律师事务所

名称:上海源泰律师事务所

住所:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址:上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人:廖海

联系电话:021)51150298

传真:021)51150398

联系人:廖海

经办律师:廖海、黎明

(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

住所:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

办公地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法定代表人:蒋伟强

电话:8621- 2212 2888

传真:8621- 6288 1889

联系人:王国蓓

经办注册会计师:王国蓓、黄小熠

四、基金的名称

信诚三得益债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在保证基金资产的较高流动性和稳定性基础上,严格控制风险,同时通过主动管理,追求超越业绩比较基准的投资收益率。

七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)资产支持证券、央行票据、短期融资券、回购等固定收益证券品种的比例为基金资产的80%-95%;投资于权益类资产(固定收益类资产以外的其它资产,包括股票、权证等)的比例为基金资产的0-20%。本基金持有现金或到期日不超过一年的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

本基金不主动参与二级市场权证的投资,但允许因投资一级市场分离式转债获配等原因被动持有的权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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

1.债券类资产的投资策略

本基金将采取自上而下、积极投资和控制风险的债券投资策略,在战略配置上,主要通过对收益率的预期,进行有效的久期管理,实现债券的整体配置;在战术配置上采取跨市场套利、收益率曲线策略和信用利差策略等对个券进行选择,在严格控制固定收益品种的流动性和信用等风险的基础上,获取超额收益。对于可转债的投资采用公司分析法和价值分析。

(1)战略配置

1)利率走势综合判断

本基金将密切关注国际和国内经济体的运行,对整体市场投资环境的进行有效预测;根据宏观经济运行指标、金融市场的运行情况以及国家财政货币政策动向等因素,定期对各个时间段利率的变化做出合理判断,构造利率期限结构的预判。

2)目标久期的设定和管理

根据对利率期限结构变化的预判,本基金将对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低可能的利率变化给组合带来的损失。具体久期目标的确定将视利率期限结构变化方向而定。

(2)战术配置

1)跨市场配置策略

利用两市场间同一品种的收益率差异,通过在一个市场买进、另一个市场卖出的方式获取利差,操作品种主要是跨市场现券或回购。

2)收益率曲线策略

通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。

3)信用利差策略

基于不同债券市场板块间利差从而在组合中分配资本的方法。

(3)个券选择

本基金将积极参与国债、金融债、央行票据一级市场投标,增加盈利空间。在个券选择上加强单个债券的定价和收益率分析,通过在我国债券市场上寻找短期内错误定价的债券,进行有效的投资获取较高收益。借助金融工程技术,研究市场期限结构和债券定价模型,选择价格被低估的央行票据和债券,获得超额收益。

(4)可转换债券的投资策略

本基金采用期权定价模型等数量化估值工具,选择基础证券基本面优良的可转换债券,评定其投资价值并以合理价格买入并持有,充分享受股票的长期增长潜力和债券的安全收入优势。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

(5)资产支持证券的投资策略

本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

2.新股申购策略

本基金将结合市场的资金状况预测拟发行上市的新股(或增发新股)的申购中签率,考察它们的内在价值以及上市溢价可能,判断新股申购收益率,制定申购策略和卖出策略。一般情况下,本基金对获配新股将择机卖出,以控制基金净值的波动。若上市初价格低于合理估值,则等待至价格上升至合理价位时卖出。

3.二级市场股票投资策略

本基金股票投资将注重基本面研究,选择流动性好、估值水平较低、具有中长期投资价值的个股进行投资。同时分散个股,构建组合,以避免单一股票的特定风险。

4.衍生金融工具投资策略

本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的证券的研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。

在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较标准为80%×中信标普全债指数收益率+20%×一年期银行定期存款税后收益率。

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的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人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基金合同规定,于2013年7月12日复核了本招募更新中的投资组合报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告的财务数据截止至2013年6月30日。

1.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	固定收益投资	1,723,933,391.50	84.57
	其中:债券	1,722,413,391.50	84.50
	资产支持证券	1,520,000.00	0.07
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	27,938,041.00	1.37
6	其他资产	286,562,924.16	14.06
7	合计	2,038,434,356.66	100.00

2.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.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.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	61,828,000.00	4.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,177,549,891.50	91.03
5	企业短期融资券	467,764,000.00	36.16
6	中期票据	15,271,500.00	1.18
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,722,413,391.50	133.15

5.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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019302	13国债02	550,000	54,835,000.00	4.24
2	041351015	13中建一局CP001	500,000	49,685,000.00	3.84
3	041355016	13宝钢包装CP001	500,000	49,630,000.00	3.84
4	041356006	13华工科技CP001	400,000	39,712,000.00	3.07
5	041354032	13粤电航运CP002	400,000	39,620,000.00	3.06

6.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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	061205001	12上元1A	50,000	1,520,000.00	0.12

注:本基金本报告期末仅持有上述1只资产支持证券。

7.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.投资组合报告附注

8.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

8.2本基金投资的前十名股票中,没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

8.3 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	204,775.25
2	应收证券清算款	10,069,071.81
3	应收股利	-
4	应收利息	40,244,423.97
5	应收申购款	236,044,653.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	286,562,924.16

8.4 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。

8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值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招募说明书。基金业绩数据截至2013年6月30日。

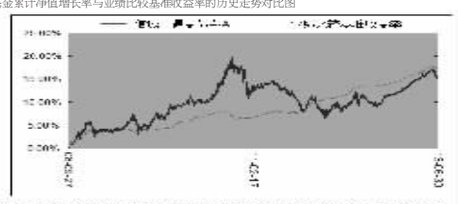
(一)A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2008年9月27日至2008年12月31日	5.19%	0.22%	3.69%	0.10%	1.50%	0.12%
2009年1月1日至2009年12月31日	2.24%	0.24%	0.67%	0.05%	1.57%	0.19%
2010年1月1日至2010年12月31日	7.79%	0.30%	2.07%	0.05%	5.72%	0.25%
2011年1月1日至2011年12月31日	-6.49%	0.27%	3.70%	0.05%	-10.19%	0.22%
2012年1月1日至2012年12月31日	3.73%	0.22%	3.88%	0.03%	-0.15%	0.19%
2013年1月1日至2013年6月30日	3.00%	0.11%	2.39%	0.04%	0.61%	0.07%
2008年9月27日至2013年6月30日	15.82%	0.25%	17.52%	0.05%	-1.70%	0.20%

B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2008年9月27日至2008年12月31日	5.09%	0.21%	3.69%	0.10%	1.40%	0.11%
2009年1月1日至2009年12月31日	1.56%	0.23%	0.67%	0.05%	0.89%	0.18%
2010年1月1日至2010年12月31日	7.35%	0.30%	2.07%	0.05%	5.28%	0.25%
2011年1月1日至2011年12月31日	-6.90%	0.27%	3.70%	0.05%	-10.60%	0.22%
2012年1月1日至2012年12月31日	3.34%	0.23%	3.88%	0.03%	-0.54%	0.20%
2013年1月1日至2013年6月30日	2.73%	0.11%	2.39%	0.04%	0.34%	0.07%
2008年9月27日至2013年6月30日	13.24%	0.25%	17.52%	0.05%	-4.28%	0.20%

(二)A级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



(三)B级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

注:本基金建仓期自2008年9月27日至2009年3月26日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、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)基金财产拨划支付的银行费用;

(4)基金信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

(7)基金的证券交易费用;

(8)在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,销售服务费的具体计提方法、计提标准在招募说明书或有关公告中载明;

(9)被照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

3、基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的