

**信达澳银鑫安债券型证券投资基金  
(LOF)  
招募说明书（更新）摘要  
2017年第2期**

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一八年二月

## 重要提示

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金于 2011 年 11 月 4 日经中国证监会证监许可【2011】1750 号文核准募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2012 年 5 月 7 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》，信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同生效后 3 年期届满，信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金自动转换为上市开放式基金（LOF）后，基金名称为“信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）”。

2016 年 7 月 22 日基金管理人经营管理委员会同意将“信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）”的基金名称变更为“信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）”。2016 年 12 月 5 日至 2016 年 12 月 23 日 17:00 止，信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会讨论通过了信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）的转型议案，内容包括调整该基金的投资目标、投资范围、投资策略、估值方法以及按照相关法律法规及中国证监会的有关规定修订基金合同等，并更名为“信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）”。上述基金份额持有人大会决定事项已于 2016 年 12 月 26 日通过，并于 2016 年 12 月 27 日起《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》同时失效，信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）正式变更为信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），本基金当事人将按照《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）基金合同》享有权利并承担义务。

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变更注册，但中国证监会对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做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，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦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。

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。

本基金是债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，长期风险收益特征高于货币市场基金，低于股票基金、混合基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书中与托管业务相关的更新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 2017 年 12 月 25 日，所载财务数据和净值表现截至 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9层

邮政编码：518054

成立日期：2006年6月5日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2006】071号

法定代表人：于建伟

电话：0755-83172666

传真：0755-83199091

联系人：郑妍

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元

股本结构：信达证券股份有限公司出资 5400 万元，占公司总股本的 54%；康联首域集团有限公司（Colonial First State Group Limited）出资 4600 万元，占公司总股本的 46%

存续期间：持续经营

### （二）主要人员情况

#### 1、董事、监事、高级管理人员董事：

董事：

于帆先生，董事长，毕业于厦门大学法律系。1987年7月至1988年10月任化工部管理干部学院经济系法学教师，1988年10月至1999年6月任中国信

达信托投资公司部门副总经理、部门总经理，1999年6月至2000年9月任中国信达资产管理公司债权管理部高级经理，2000年9月至2007年9月任宏源证券股份有限公司董事会秘书、副总经理，2007年9月至2011年10月任信达证券股份有限公司党委委员、董事会秘书、副总经理、常务副总经理，2011年10月至2013年8月任中国信达资产管理公司投融资业务部总经理，2013年8月至今任信达证券股份有限公司董事、总经理。2014年9月16日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事长。

施普敦（Michael Stapleton）先生，副董事长，澳大利亚墨尔本 Monash 大学经济学学士。1996年至1998年担任 JP 摩根投资管理有限公司（澳大利亚）机构客户经理，1998年加入康联首域投资有限公司机构业务开发部门，负责澳大利亚机构客户销售和关系管理，2002年加入首域投资国际（伦敦），历任机构销售总监、机构业务开发主管，2009年6月起担任首域投资有限公司（香港）亚洲及日本区域董事总经理。

于建伟先生，董事，中央财政金融学院金融专业学士，东北财经大学 EMBA。30年证券从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989年至1996年在中国建设银行信托投资公司工作，历任证券部副总经理、深圳证券业务部总经理、资产中介部负责人；1996年至2000年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理；2000年至2004年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理；2004年至2008年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理；2008年至2013年5月任世纪证券有限公司副总裁；2013年7月加入信达澳银基金管理有限公司，2013年8月9日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

潘广建先生，英国伯明翰大学工商管理硕士，加拿大注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所稽核部、香港期货交易所监察部。1997年起历任山一证券分析师、香港证券及期货事务监察委员会助理经理、香港强制性公积金计划管理局经理、景顺亚洲业务发展经理、景顺长城基金管理公司财务总监、AXA 国卫市场部助理总经理、银联信托有限公司市场及产品部主管。潘广建先生于2007年5月起任首域投资（香港）有限公司中国业务开发董事并于同年兼任信达澳银基金管理公司监事至2016年5月13日，自2016年5月14日起，潘广建先生兼任信

达澳银基金管理公司董事。

孙志新先生，独立董事，山西财经学院财政金融学学士，高级经济师。历任中国建设银行总行人事教育部副处长，总行教育部副主任，总行监察室主任，广东省分行党组副书记、副行长，广西区分行党委书记、行长，总行人力资源部总经理（党委组织部部长），总行个人业务管理委员会副主任，总行党校（高级研修院）常务副校长，总行人力资源部总经理（党委组织部部长），总行工会常务副主席，总行监事会监事，于 2011 年 1 月退休。

刘颂兴先生，独立董事，香港中文大学工商管理硕士。历任 W. I. Carr（远东）有限公司投资分析师，霸菱国际资产管理有限公司投资分析师、投资经理，纽约摩根担保信托公司 Intl 投资管理副经理，景顺亚洲有限公司投资董事，汇丰资产管理（香港）有限公司（2005 年 5 月起改组为汇丰卓誉投资管理公司）股票董事，中银保诚资产管理有限公司投资董事，新鸿基地产有限公司企业策划总经理，中国平安资产管理（香港）有限公司高级副总裁兼股票投资董事，中国国际金融（香港）有限公司资产管理部执行董事，Seekers Advisors（香港）有限公司执行董事兼投资总监。2012 年 6 月 19 日起担任广发资产管理（香港）有限公司董事总经理。

刘治海先生，独立董事，全国律师协会公司法专业委员会委员，北京市人大立法咨询专家，中国政法大学法学硕士，历任江苏省盐城市政法干校干部，首都经贸大学经济系讲师，自 1993 年 2 月起担任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。2015 年 5 月 8 日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

执行监事：

郑妍女士，中国农业大学管理学硕士，现任监察稽核部副总监。2007 年 5 月加入信达澳银基金管理有限公司，历任客户服务部副总经理、监察稽核部副总经理、监察稽核总监助理。自 2015 年 1 月起兼任信达澳银基金管理有限公司职工监事。

高级管理人员：

于建伟先生，总经理，中央财政金融学院金融专业学士，东北财经大学 EMBA。30 年证券从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高管人员任职资格。1989 年至 1996 年在中国建设银行信托投资公司工作，历任证券部副总经理、深圳证

券业务部总经理、资产中介部负责人；1996年至2000年任中国科技国际信托投资有限公司天津赤峰道证券营业部总经理；2000年至2004年任宏源证券有限公司北京北洼路营业部总经理；2004年至2008年任宏源证券有限公司营销经纪总部总经理；2008年至2013年5月任世纪证券有限公司副总裁；2013年7月加入信达澳银基金管理有限公司，2013年8月9日起任信达澳银基金管理有限公司总经理兼任信达新兴财富资产管理有限公司执行董事。

黄晖女士，督察长，中南财经大学经济学学士，加拿大 Concordia University 经济学硕士。21年证券、基金从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1999年起历任大成基金管理有限公司研究部分析师、市场部副总监、规划发展部副总监、机构理财部总监等职务，其间两次借调到中国证监会基金部工作，参与老基金重组、首批开放式基金评审等工作。2000-2001年参与英国政府“中国金融人才培养计划”（FIST项目），任职于东方汇理证券公司（伦敦）。2005年8月加入信达澳银基金管理有限公司，任督察长兼董事会秘书。

于鹏先生，副总经理，中国人民大学经济学学士。24年证券、基金从业经历，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。历任中国建设银行总行信托投资公司证券总部驻武汉证券交易中心交易员、计划财务部会计、深圳证券营业部计划财务部副经理、经理；中国信达信托投资公司北京证券营业部总经理助理兼计财部经理；宏源证券股份有限公司北京营业部副总经理、机构管理总部业务监控部经理兼清算中心经理、资金财务总部副总经理、资金管理总部总经理兼客户资金存管中心总经理等职务。2005年10月加入信达澳银基金管理有限公司，历任财务总监、总经理助理兼财务总监、副总经理。

王咏辉先生，总经理助理，英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士，20年证券、基金从业经验。曾任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师，汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，泰达宏利基金管理公司（Manulife Teda）国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司，任总

经理助理兼投资总监。王咏辉先生具备基金从业资格，英国基金经理从业资格（IMC），英国 IET 颁发的特许工程师（CEng）认证资格。

## 2、基金经理

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学峰	本基金的基金经理，稳定价值债券基金、信用债债券基金、慧管家货币基金、纯债债券基金、慧理财货币基金、新目标混合基金的基金经理，公募投资总部副总监	2012-5-7	-	14 年	中央财经大学金融学硕士。历任金元证券股份有限公司研究员、固定收益总部副总经理；2011 年 8 月加入信达澳银基金公司，历任投资研究部下固定收益部总经理、固定收益副总监、固定收益总监、公募投资总部副总监，信达澳银稳定价值债券基金基金经理（2011 年 9 月 29 日起至今）、信达澳银鑫安债券基金（LOF）基金经理（2012 年 5 月 7 日起至今）、信达澳银信用债债券基金基金经理（2013 年 5 月 14 日起至今）、信达澳银慧管家货币基金基金经理（2014 年 6 月 26 日起至今）、信达澳银纯债债券基金基金经理（2016 年 8 月 4 日起至今）、信达澳银慧理财货币基金基金经理（2016 年 9 月 30 日起至今）、信达澳银新目标混合基金基金经理（2016 年 10 月 25 日起至今）。

## 3、公司投资审议委员会

公司公募基金投资审议委员会由 6 名成员组成，设主席 1 名，委员 5 名。

名单如下：



主席：于建伟，总经理

委员：

王咏辉，投资总监、总经理助理

曾国富，公募投资总部副总监、基金经理

孔学峰，公募投资总部副总监、基金经理

张培培，投委会秘书、基金经理

刘涛，产品创新部副总监

上述人员之间不存在亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1. 基本情况

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：田国立

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整

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

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81% 至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2. 主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产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、战略客户部，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。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3. 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、(R)QFII、(R)QDII、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 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国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。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3. 内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完

整、独立。

（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. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2. 监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### （一）销售机构及联系人

##### 1、直销机构

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1栋8、9层

法定代表人：于建伟

电 话：0755-82858168/0755-83077068

传 真：0755-83077038

联系人：王丽燕

公司网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

邮政编码：518054

## 2、代销机构

序号	名称	注册地址	法定代 表人	办公地址	客服电话	联系人	网站
1	<a href="http://www.ccb.com">中国建设银行股份有限公司</a>	北京市西城区金融大街 25 号	王洪章	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	95533	王琳	<a href="http://www.ccb.com">www.ccb.com</a>
2	<a href="http://www.cmbchina.com">招商银行股份有限公司</a>	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦	李建红	同“注册地址”	95555	邓炯鹏	<a href="http://www.cmbchina.com">www.cmbchina.com</a>
3	<a href="http://www.bankcomm.com">交通银行股份有限公司</a>	上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路 188 号	牛锡明	同“注册地址”	95559	胡佳敏	<a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a>
4	<a href="http://bank.ecitic.com">中信银行股份有限公司</a>	北京东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦中信银行总行 12 层	李庆萍	同“注册地址”	95558	王晓琳	<a href="http://bank.ecitic.com">bank.ecitic.com</a>
5	<a href="http://www.bank.pingan.com">平安银行股份有限公司</a>	深圳市罗湖区深南东路 5047 号	谢永林	同“注册地址”	95511-3	冯博	<a href="http://www.bank.pingan.com">www.bank.pingan.com</a>
6	<a href="http://www.hccb.com.cn">杭州银行股份有限公司</a>	杭州市下城区庆春路 46 号	陈震山	同“注册地址”	0571-96523 /400888850 8	金超龙	<a href="http://www.hccb.com.cn">www.hccb.com.cn</a>
7	<a href="http://www.ncbchina.cn/cn/index.html">南洋商业银 行（中国） 有限公司</a>	上海市浦东新区世纪大道 800 号三层、六层至九层	岳毅	上海市浦东新区世纪大道 800 号南洋商业银行大厦	8008302066 / 4008302066	宋雯	<a href="http://www.ncbchina.cn/cn/index.html">www.ncbchina.cn/cn/index.html</a>
8	<a href="http://www.hfbank.com.cn">恒丰银行股份 有限公司</a>	山东省烟台市芝罘区南大街 248 号	蔡国华	同“注册地址”	95395	李胜贤	<a href="http://www.hfbank.com.cn">www.hfbank.com.cn</a>
9	<a href="http://www.cindasc.com">信达证券股份 有限公司</a>	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	张志刚	同“注册地址”	95321	唐静	<a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a>

10	<u>中国银河证券股份有限公司</u>	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	陈共炎	同“注册地址”	4008888888	邓颜	<a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a>
11	<u>中信建投证券股份有限公司</u>	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	王常青	北京市朝阳区内大街 188 号	4008888108	许梦园	<a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a>
12	<u>申万宏源证券有限公司</u>	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	李梅	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	95523/4008895523	曹晔	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>
13	<u>申万宏源西部证券有限公司</u>	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	韩志谦	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	4008000562	唐岚	<a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a>
14	<u>华龙证券股份有限公司</u>	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼	李晓安	同“注册地址”	4006898888/0931-96668	范坤、杨力	<a href="http://www.hlzqgs.com">www.hlzqgs.com</a>
15	<u>中信证券股份有限公司</u>	广东省深圳市福田区中心 3 路 8 号卓越时代广场（二期）北座	张佑君	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 18 层	95558	周雪晴	<a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a>
16	<u>中信证券（山东）有限责任公司</u>	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层	姜晓林	同“注册地址”	95548	孙秋月	<a href="http://www.citicssd.com">www.citicssd.com</a>
17	<u>国泰君安证券股份有限公司</u>	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	杨德红	上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层	95521	芮敏祺、钟伟镇	<a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>
18	<u>光大证券股份有限公司</u>	上海市静安区新闻路 1508 号	薛峰	同“注册地址”	4008888788/95525	刘晨	<a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>
19	<u>兴业证券股份有限公司</u>	福建省福州市湖东路 268 号	杨华辉	上海市浦东新区长柳路 36 号	95562	乔琳雪	<a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a>
20	<u>海通证券股份有限公司</u>	上海市淮海中路 98 号	王开国	上海市广东路 689 号海通证券大厦	4008888001/021-95553	王立群	<a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>
21	<u>招商证券股份有限公司</u>	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层	霍达	同“注册地址”	95565/4008888111	黄婵君	<a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>

22	<u>国信证券股份有限公司</u>	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 楼	何如	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层	95536	容榕、李颖	<a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
23	<u>广发证券股份有限公司</u>	广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）	孙树明	广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼	95575	黄岚	<a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>
24	<u>安信证券股份有限公司</u>	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	王连志	同“注册地址”	4008001001	郑向溢	<a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a>
25	<u>平安证券股份有限公司</u>	深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层	曹实凡	同“注册地址”	95511-8	石静武	<a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a>
26	<u>世纪证券有限责任公司</u>	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层	姜味军	同“注册地址”	0755-83199509	王雯、陈玮	<a href="http://www.csc.com.cn">www.csc.com.cn</a>
27	<u>华福证券有限责任公司</u>	福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	黄金琳	福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层	0591-96326	郭相兴	<a href="http://www.gfhfzq.com.cn">www.gfhfzq.com.cn</a>
28	<u>华泰证券股份有限公司</u>	南京市江东中路 228 号	周易	南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场	95597	庞晓芸	<a href="http://www.htsc.com.cn">www.htsc.com.cn</a>
29	<u>广州证券股份有限公司</u>	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层	邱三发	同“注册地址”	020-961303	梁微	<a href="http://www.gzs.com.cn">www.gzs.com.cn</a>
30	<u>新时代证券股份有限公司</u>	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501	叶顺德	同“注册地址”	4006989898	田芳芳	<a href="http://www.xsdzq.cn">www.xsdzq.cn</a>
31	<u>长江证券股份有限公司</u>	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦	尤习贵	同“注册地址”	95579/4008888999	奚博宇	<a href="http://www.95579.com">www.95579.com</a>
32	<u>浙商证券股份有限公司</u>	浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座	吴承根	上海市长乐路 1219 号长鑫大厦 18 楼	95345	陈韵	<a href="http://www.stocke.com.cn">www.stocke.com.cn</a>
33	<u>中泰证券股份有限公司</u>	济南市市中区经七路 86 号	李玮	同“注册地址”	95538	秦雨晴、许曼华	<a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a>

34	<u>联讯证券股份有限公司</u>	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	徐刚	同“注册地址”	95564	彭莲	<a href="http://www.lxsec.com">www.lxsec.com</a>
35	<u>长城证券有限责任公司</u>	深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层	黄耀华	深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 层	4006666888 /0755-3368 0000	金夏、胡永君	<a href="http://www.cgws.com">www.cgws.com</a>
36	<u>恒泰证券股份有限公司</u>	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号	庞介民	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14 层	4001966188	熊丽	<a href="http://www.cnht.com.cn">www.cnht.com.cn</a>
37	<u>太平洋证券股份有限公司</u>	云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层	李长伟	北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元	400-665-09 99	王婧	<a href="http://www.tpyzq.com">www.tpyzq.com</a>
38	<u>国金证券股份有限公司</u>	四川省成都市东城根上街 95 号	冉云	同“注册地址”	95310	刘婧漪	<a href="http://www.gjq.com.cn">www.gjq.com.cn</a>
39	<u>华金证券股份有限公司</u>	上海市浦东新区杨高南路 759 号(陆家嘴世纪金融广场)30 层、31 层	宋卫东	同“注册地址”	4008211357	黄昆龙	<a href="http://www.huajinsec.com">www.huajinsec.com</a>
40	<u>首创证券有限责任公司</u>	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座	吴涛	同“注册地址”	4006200620	刘宇	<a href="http://www.sczq.com.cn">www.sczq.com.cn</a>
41	<u>华西证券股份有限公司</u>	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦	杨炯洋	同“注册地址”	95584	谢国梅	<a href="http://www.hx168.com.cn">www.hx168.com.cn</a>
42	<u>山西证券股份有限公司</u>	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼	侯巍	同“注册地址”	4006661618 、95573	郭熠	<a href="http://www.i618.com.cn">www.i618.com.cn</a>
43	<u>天相投资顾问有限公司</u>	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701	林义相	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层	010-660456 78	尹伶	<a href="http://www.txsec.com">www.txsec.com</a> / <a href="http://www.jjm.com.cn">www.jjm.com.cn</a>
44	<u>诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司</u>	上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室	汪静波	同“注册地址”	4008215399	张裕、李娟	<a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>
45	<u>深圳众禄金融控股股份有限公司</u>	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801	薛峰	深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼	4006788887	童彩平	<a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a> 及 <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a>



46	<u>上海天天基金销售有限公司</u>	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	其实	上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼	4001818188	王逐一	<a href="http://www.1234567.com.cn">www.1234567.com.cn</a>
47	<u>上海好买基金销售有限公司</u>	上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	杨文斌	同“注册地址”	4007009665	徐超逸	<a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a>
48	<u>蚂蚁（杭州）基金销售有限公司</u>	杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室	陈柏青	杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼	4000766123	徐丽玲、 铄金、祝红艳	<a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>
49	<u>和讯信息科技有限公司</u>	北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室	王莉	同“注册地址”	4009200022	刘洋	<a href="http://licaike.hexun.com">licaike.hexun.com</a>
50	<u>浙江同花顺基金销售有限公司</u>	杭州市文二西路一号903室	凌顺平	同“注册地址”	4008773772	朱琼	<a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>
51	<u>上海联泰资产管理有限公司</u>	中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室	燕斌	上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼	4001666788	陈东	<a href="http://www.66zichan.com">www.66zichan.com</a>
52	<u>北京展恒基金销售股份有限公司</u>	北京市顺义区后沙峪镇安富街6号	闫振杰	北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层	4008188000	乌兰其格、 李露平	<a href="http://www.myfund.com">www.myfund.com</a>
53	<u>众升财富（北京）基金销售有限公司</u>	北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室	李招娣	北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	4008769988	李艳	<a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a>
54	<u>上海长量基金销售投资顾问有限公司</u>	上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	张跃伟	上海市浦东新区东方路1267号11层	4008202899	詹慧萌	<a href="http://www.erichfund.com">www.erichfund.com</a>
55	<u>嘉实财富管理有限公司</u>	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元	赵学军	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层	4000218850	余永键	<a href="http://www.harvestwm.cn">www.harvestwm.cn</a>
56	<u>北京虹点基金销售有限公司</u>	北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603	董浩	北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层	4006180707	葛亮	<a href="http://www.hongdianfund.com">www.hongdianfund.com</a>
57	<u>上海陆金所资产管理有限公司</u>	上海市自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元	郭坚	同“注册地址”	4008219031	程晨	<a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>

58	<u>上海利得基金销售有限公司</u>	上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室	李兴春	上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼	4009217755	曹怡晨	<a href="http://a.leadfund.com.cn">a.leadfund.com.cn</a>
59	<u>珠海盈米财富管理有限公司</u>	珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491	肖雯	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	020-89629066	邱湘湘、曾健灿	<a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a>
60	<u>北京创金启富投资管理有限公司</u>	北京市西城区西单民丰胡同 31 号中水大厦 215A 室	梁蓉	北京西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 综合楼 712 室	010-66154828	郭爱丽	<a href="http://www.5irich.com">www.5irich.com</a>
61	<u>北京钱景基金销售有限公司</u>	北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012	赵荣春	同“注册地址”	4008936885	陈剑炜	<a href="http://www.qianjing.com">www.qianjing.com</a>
62	<u>中证金牛（北京）投资咨询有限公司</u>	北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室	钱昊旻	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层	4008909998	孙雯	<a href="http://www.jnlc.com">www.jnlc.com</a>
63	<u>北京广源达信基金销售有限公司</u>	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室	齐剑辉	北京市朝阳区望京宏泰东街 浦项中心 B 座 19 层	4006236060	王英俊	<a href="http://www.niuniufund.com">www.niuniufund.com</a>
64	<u>北京晟视天下投资管理有限公司</u>	北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室	蒋煜	北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 28 层	4008188866	殷雯	<a href="http://www.shengshiview.com">www.shengshiview.com</a>
65	<u>上海万得基金销售有限公司</u>	中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座	王廷富	上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼	4008210203	徐亚丹	<a href="http://www.520fund.com.cn">www.520fund.com.cn</a>
66	<u>北京富国大通资产管理有限公司</u>	北京市东城区北三环东路 36 号 1 号楼 A2501 室	宋宝峰	同“注册地址”	4000880088	张玥	<a href="http://www.fuguowealth.com">www.fuguowealth.com</a>
67	<u>上海基煜基金销售有限公司</u>	上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）	王翔	上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室	4008205369	吴鸿飞	<a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>
68	<u>北京唐鼎耀华投资咨询有限公司</u>	北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室	张冠宇	北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层	4008199868	刘美薇	<a href="http://www.tdyhfund.com">www.tdyhfund.com</a>
69	<u>深圳市新兰德证券投资咨询有限公司</u>	深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#	马勇	北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层	4001661188	文雯	<a href="http://8.irj.com.cn/">8.irj.com.cn/</a>

70	<u>北京汇成基金销售有限公司</u>	北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108	王伟刚	同“注册地址”	4006199059	熊小满、李瑞真	<a href="http://www.hcjijin.com">www.hcjijin.com</a>
71	<u>大泰金石投资管理有限公司</u>	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	袁顾明	同“注册地址”	4009282266	何庭宇	<a href="http://www.dtfunds.com">www.dtfunds.com</a>
72	<u>中民财富管理（上海）有限公司</u>	上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元	弭洪军	上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层	4008765716	茅旦青	<a href="http://www.cmiwm.com">www.cmiwm.com</a>
73	<u>北京肯特瑞财富投资管理有限公司</u>	北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06	陈超	北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部	95118/4000988511	万容	<a href="http://kenterui.jd.com">kenterui.jd.com</a> / <a href="http://fund.jd.com/">fund.jd.com/</a>
74	<u>喜鹊财富基金销售有限公司</u>	西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室	陈皓	同“注册地址”	0891-6177483	曹砚财	<a href="http://www.xiquefund.com">www.xiquefund.com</a>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

## （2）场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体销售机构见深圳证券交易所网站（[www.szse.com](http://www.szse.com)）。

## （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：周明

电话：010-59378839

传真：010-59378907

联系人：朱立元

## （三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法定代表人（执行事务合伙人）：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：昌华

经办注册会计师：昌华、高鹤

#### 四、基金的名称

信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）

#### 五、基金的运作方式和类型

运作方式：上市契约型开放式(LOF)

类型：债券型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

通过积极主动的投资及严格的风险控制，追求长期稳定的回报，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资收益。

#### 七、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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债

券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、权证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的相关规定)。

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。

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%;基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素综合分析,评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。

### 2、债券投资策略

#### (1) 类属资产配置

本基金将市场细分为不同类属,定期跟踪分析不同类属的风险收益特征,并结合该类属的市场容量、流动性确定其投资比例范围,把上述数据和目标久期等输入债券类属配置模型得到债券组合中不同类属配置比例。

本基金还将根据市场实际利率与公允值的差异、市场风险水平对最优配置比例进行调整。当市场实际利率高于公允价值时,本基金将逐步增加这类资产的头寸,目的是获得有吸引力的收入流,反之亦然。

#### (2) 收益率曲线配置策略

本基金将分析收益率曲线形态的变化,通过预测收益率曲线形态的变化,决定采用骑乘、子弹、杠铃或者梯形等策略。当预测收益率曲线为陡峭正向且较为稳定不发生形变时,采用骑乘策略及兼用杠杆放大策略;当预测收益率曲线平移或平坦化时,采取哑铃形或梯形策略构建高凸性组合;当预测收益率陡峭化时,

采用子弹形策略。

### （3）信用债投资策略

本基金信用债投资策略的核心是分散化及风险收益率的优化。

本基金将保持组合内各券种的分散化及券种之间的低相关性以获得正超额收益。

本基金在个券选择方面采用风险收益率优化策略。本基金首先采取与股票投资相似的公司分析方式，对信用债发行人的公司治理、发展前景、经营管理、财务状况及偿债能力作出综合评价，从而判断企业债的信用风险和估值水平。本基金同时对信用市场进行跟踪分析，关注宏观经济、政策环境、信用环境等对市场利差水平的影响。本基金将根据个券的估值及在市場中的水平动态调整组合，买入低估和风险收益相对高的个券，卖出高估和风险收益相对低的个券。

### （4）可转债投资策略

本基金对可转债的投资将主要采用公司分析方式，依据 QGV、ITC、MDE 体系全面评价正股的投资价值和债券的信用风险，并分别对期权部分和债券部分进行估值，从而客观评判可转债的投资价值。同时，本基金将全面分析可转债市场各券种的股债性、流动性、收益率、信用水平等特征，根据本基金的类属配置策略、流动性管理要求和前述个券投资价值，精选个券投资。

### （5）国债及中央银行票据投资策略

本基金对该类品种的投资主要专注于对影响利率水平及其预期、通胀水平及其预期的各种参数的分析和判断，如国际国内经济周期、GDP 增长率及其变化趋势、通货膨胀率及其预期、财政货币政策等，以期预测未来的利率期限结构，并基于该期限结构进行估值，以期对个券的利率风险和投资价值作出较准确的判断，策略性地决定债券投资的久期、期限结构，从而管理债券投资风险和收益。在平稳的市场利率环境下，通过回购套利投资国债及中央银行票据可以获得具备较好流动性的利差收益。对于跨市场发行的国债，由于银行间和交易所市场构成差异，还可获得跨市场交易的套利收益。国债及中央银行票据具备良好的抵押回购融资功能，对放大基金资产投资，应急大额基金赎回起到流动性支持作用。

### （6）资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前

偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略投资于资产支持证券。

#### （7）中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债券具有流动性较差、信息披露不公开、风险收益水平较高等特点，因此对该类信用产品的投资主要遵循精选个券、总量控制、分散投资、长期持有的原则。对个券投资前主要采取与股票投资相似的公司分析方式，对中小企业私募债券发行人的公司治理、发展前景、经营管理、财务状况及偿债能力作出综合评价，从而选择收益率水平与信用风险匹配，利差对违约风险和流动性风险构成合理补偿的个券进行投资。投资以后以高于普通信用债的频度对发行人的情况进行密切跟踪，包括且不限于对发行人进行电话和实地调研，与受托人、投行、评级机构等中介机构进行信息沟通等等，以保持对发行人经营状况和偿债能力变化情况的了解。对于组合里的中小企业私募债券暴露，根据本基金的类属配置策略、个券的投资价值和流动性管理要求，进行总量控制、分散投资，降低流动性和信用风险。

### 3、股票投资策略

对二级市场股票投资，本基金将在资产配置总体策略下，运用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建基金的权益资产组合。一方面，本基金通过“自上而下”的深入分析，在结合国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策的基础上，优化配置、甄选受益行业；另一方面，通过“自下而上”的深入分析精选公司素质高、核心竞争力突出、估值合理的公司，依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力，力争获得良好回报。

### 4、权证投资策略

本基金将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征以选择权证的卖出时机，追求较为稳健的当期收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%

本基金是债券型基金，投资于债券资产不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产不高于基金资产的 20%，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后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%。本基金采用“中债总财富(总值)指数收益率”、“沪深 300 指数收益率”和“金融机构人民币活期存款基准利率（税后）”分别作为股票、债券和现金类资产投资的比较基准，并将业绩比较基准中债券指数、股票指数与现金类资产的权重确定为 80%、15%和 5%，基于指数的权威性和代表性以及本基金的投资范围和投资理念，选用该业绩比较基准能够真实、客观的反映本基金的风险收益特征。

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的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整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

## 十一、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司复核了本次更新招募说明书中的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。

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。

本投资组合报告期截止至 2017 年 9 月 30 日。本报告中财务资料未经审计。

### 一) 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	6,840,260.00	12.64
	其中：股票	6,840,260.00	12.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,708,526.50	80.76
	其中：债券	43,708,526.50	80.76
	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	1,600,000.00	2.96
	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	643,667.79	1.19
8	其他资产	1,328,386.77	2.45
9	合计	54,120,841.06	100.00

## 二）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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	275,500.00	0.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,066,860.00	7.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	869,800.00	1.65
J	金融业	1,446,900.00	2.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	181,200.00	0.34
S	综合	-	-

	合计	6,840,260.00	12.94
--	----	--------------	-------

## 2. 报告期末按行业分类的沪港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。

### 三) 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	10,000	566,700.00	1.07
2	600309	万华化学	12,000	505,800.00	0.96
3	600872	中炬高新	20,000	472,600.00	0.89
4	601688	华泰证券	20,000	452,400.00	0.86
5	600038	中直股份	10,000	437,100.00	0.83
6	600999	招商证券	20,000	427,800.00	0.81
7	300059	东方财富	30,000	414,900.00	0.78
8	002766	索菱股份	20,000	393,600.00	0.74
9	601600	中国铝业	50,000	378,500.00	0.72
10	000786	北新建材	20,000	343,800.00	0.65

### 四) 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	4,568,450.00	8.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,504,000.00	55.81
	其中：政策性金融债	29,504,000.00	55.81
4	企业债券	7,087,230.00	13.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,548,846.50	4.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,708,526.50	82.67

### 五) 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	140378	14 进出 78	200,000	20,006,000.00	37.84
2	160207	16 国开 07	100,000	9,498,000.00	17.97
3	010107	21 国债(7)	40,000	4,078,800.00	7.71
4	112174	13 广田 01	26,000	2,594,280.00	4.91
5	136017	15 名城 01	25,000	2,490,750.00	4.71

六) 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。

七) 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。

八) 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。

九) 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

注：本基金未参与投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

十) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

万华化学（600309）于2017年7月6日发布《关于2016年9月20日安全事故调查结果的公告》，公司收到烟台安监局对“万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入40%的罚款，对万华化学集团股份有限公司处以80万元罚款”的处罚。主要原因为仪表操作人员没有按操作规程将DAM管线远程开关阀关闭，造成DAM误入反应系统，与系统中粗M反应生成缩聚脲和缩二脲，并发生聚合反应，导致压力平衡管堵塞，最终引起爆炸。该事故主要因员工操作不规范导致，现公司已加强管理，提高各级管理人员和员工的安全意识和责任心，确保公司安全稳定运行。

基金管理人经审慎分析，认为上述事件对该公司经营和价值不会构成重大影响。

国君转债（113013）于2016年12月27日发布《国泰君安关于收到中国证券监督管理委员会行政监管措施事先告知书的公告》，受到监管机构处罚，主要原因为：一是在推荐河北润农节水科技股份有限公司进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、存货情况的核查不充分；二是在持续督导参仙源参业股份有限公司过程中，企业被立案稽查后，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》；三是在推荐新疆瑞兆源生态农业股份有限公司进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。该公司主要因业务不规范等问题受到监管部门的行政处罚，现已按照监管要求进行整改，并加强和完善新三板推荐挂牌业务的合规经营和风险管理。

基金管理人经审慎分析，认为上述事件对该公司经营和价值不会构成重大影响。

除万华化学（600309）、国君转债（113013）外，其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	7,965.22
2	应收证券清算款	224,195.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,070,028.71
5	应收申购款	992.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,205.72
8	其他	-
9	合计	1,328,386.77

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110032	三一转债	236,120.00	0.45

注：本基金本报告期末仅持有上述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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说 明
1	601600	中国铝业	378,500.00	0.72	重大事项停牌

#### 6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 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预示其未来表现。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

（一）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（截至2017年9月30日）：

阶段	份 额 净 值 增 长	份 额 净 值 增 长 率 标 准 差	业 绩 比 较 基 准 收 益	业 绩 比 较 基 准 收 益 率 标	①—③	②— ④

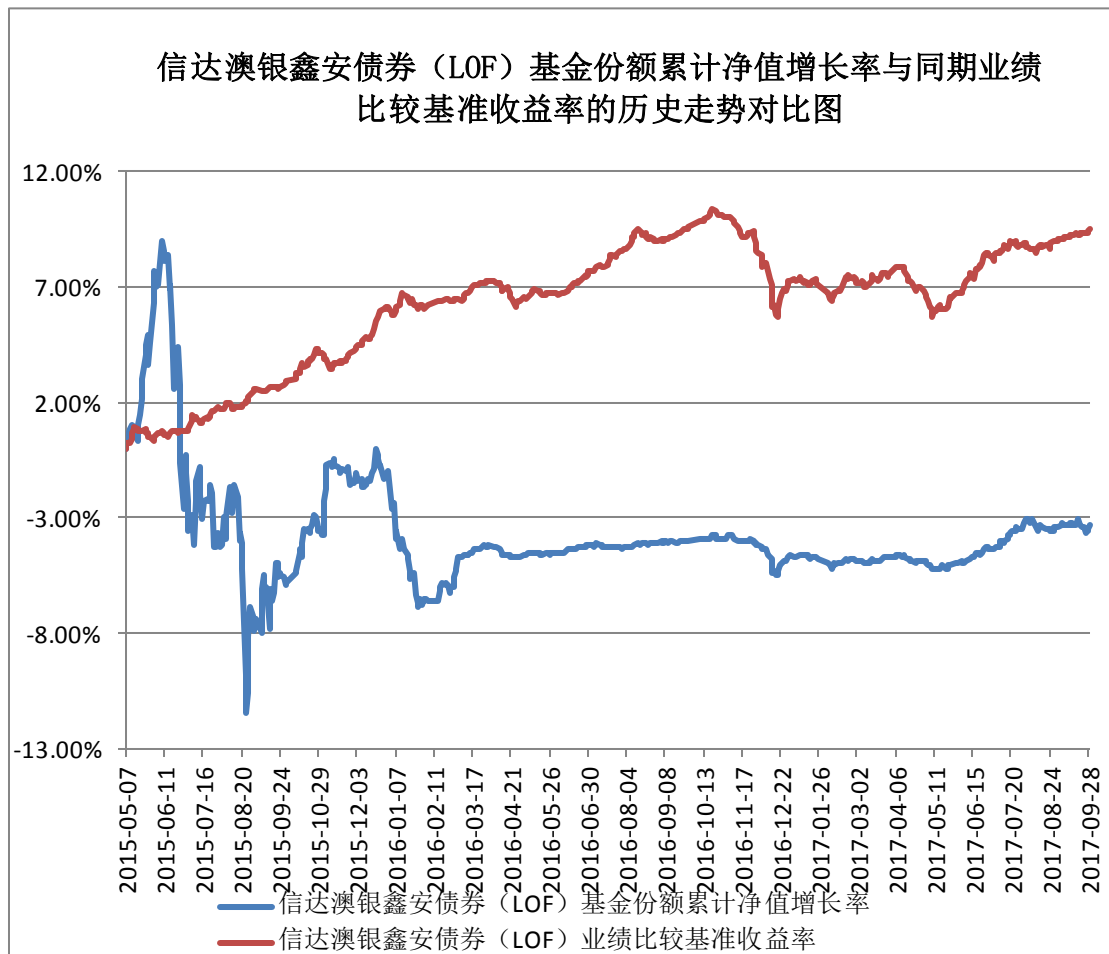
	率①	②	率③	准差④		
2012 年 (2012 年 5 月 7 日至 2012 年 12 月 31 日)	2.01%	0.13%	2.00%	0.08%	0.01%	0.05%
2013 年 (2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日)	-6.43%	0.39%	-2.10%	0.11%	-4.33%	0.28%
2014 年 (2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日)	21.15 %	0.49%	11.23%	0.15%	9.92%	0.34%
2015 年至 转型前一日 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 6 日)	-0.88%	0.71%	1.79%	0.14%	-2.67%	0.57%
自基金合同 生效起至转 型前一日 (2012 年 5 月 7 日至 2015 年 5 月 6 日)	14.62 %	0.44%	13.06%	0.12%	1.56%	0.32%

自基金转型为信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）期间，业绩如下：

阶段	份 额 净 值 增 长 率①	份 额 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
自基金转型 日 起 至 2015 年 底 (2015 年 5 月 7 日至 2015 年 12 月 31 日)	-1.00%	0.94%	6.13%	0.10%	-7.13%	0.84%

2016 年 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)	-3.64%	0.21%	1.13%	0.12%	-4.77%	0.09%
2017 年 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日)	1.36%	0.09%	2.03%	0.12%	-0.67%	-0.03 %
自基金转型 日起至今 (2015 年 5 月 7 日至 2017 年 9 月 30 日)	-3.30%	0.52%	9.50%	0.12%	-12.80 %	0.40%

(二) 自基金转型为信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF) 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：1、本基金于 2015 年 5 月 15 日开放日常申购、赎回、转换业务,并于 2015 年 6 月 4 日开始在深圳证券交易所上市交易。

2、本基金于 2016 年 12 月 27 日由“信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）”变更为“信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）”。

3、2016 年 12 月 27 日起本基金的投资组合比例变更为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的 20%；基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

### 十三、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. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
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、律师费、诉讼费和仲裁费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 基金上市初费和上市月费；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

#### （三）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



在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

## 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### (四) 不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### (五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况在履行适当的程序后调

整基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《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规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于 2017 年 8 月 8 日生效的本基金的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”部分，修改了本基金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；

（二）在“三、基金管理人”部分，更新了管理人的相关信息：

- 1、更新了基金管理人证券投资基金管理情况
- 2、更新了基金管理人董事、监事、高级管理人员的相关信息；
- 3、更新了基金经理的相关信息；
- 4、更新了公司投资审议委员会的相关信息；

（三）在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息；

（四）在“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构、会计事务所和经办注册会计师的相关信息；

（五）在“九、基金的投资”部分，更新了本基金最近一期投资组合报告内容，数据截至 2017 年 9 月 30 日；

（六）在“十、基金的业绩”部分，更新了基金业绩相关数据，数据截至 2017 年 9 月 30 日；

（七）在“十九、对基金份额持有人的服务”部分，更新了服务内容中理财服务部分的相关信息；

（八）在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了本基金的其他应披露事项列表。

信达澳银基金管理有限公司

二〇一八年二月六日