

# 方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

## 2019 年第 1 号

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

二〇一九年八月

### 重要提示

方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2016 年 10 月 31 日证监许可【2016】2493 号文准予注册募集。本基金的基金合同于 2016 年 12 月 19 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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

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，本基金的特有风险等。

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。

本基金为债券型基金，其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，属于中低风险的基金品种。投资有风险，投资者认(申)购基金份额时应认真阅读本招募说明书及基金合同，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。

投资者应当通过本基金管理人或其他销售机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元从而遭受损失的风险。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

本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，由投资者自行承担。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 6 月 19 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日(未经审计)。

## 一、基金管理人

### (一)基金管理人概况

名称：方正富邦基金管理有限公司

住所：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层

法定代表人：何亚刚

设立日期：2011 年 7 月 8 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：6.6 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：010-57303969

传真：010-57303716

联系人：戴兴卓

方正富邦基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监许可〔2011〕1038 号文批准设立。

公司股权结构如下：

股东名称 股权比例

方正证券股份有限公司 66.7%

富邦证券投资信托股份有限公司 33.3%

### (二)主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

何亚刚先生，董事长，硕士。曾任泰阳证券有限责任公司部门总经理，民生证券有限责任公司总裁助理，方正证券有限责任公司助理总裁，泰阳证券有限责任公司总裁，方正期货有限公司董事长，方正证券有限责任公司副总裁，方正富邦基金管理有限公司监事、董事。现任方正证券股份有限公司董事、执行委员会副主任、总裁、首席运营官(COO)、党委委员、代行董事会秘书，方正和生投资有限责任公司董事长、法定代表人，方正中期期货有限公司董事，北京方正富邦创融资产管理有限公司董事，方正证券(香港)金融控股有限公司董事，湖南省证券业协会会长,瑞信方正证券有限责任公司董事。

史纲先生，副董事长，博士。曾任 Bridgewater Group(USA)副总经理、台湾中央大学教授，台湾国际证券股份有限公司副总经理，富邦综合证券股份有限公司副总经理、顾问、代理董事长、副董事长，富邦期货股份有限公司董事长，富邦商业银行股份有限公司董事，富邦证券投资信托股份有限公司董事长，富邦康宏资产管理(香港)有限公司董事长。现任富邦综合证券股份有限公司董事长，富邦证股权投资有限公司董事长，富邦证创业投资股份有限公司董事长，富邦闽投创业投资股份有限公司董事长，富邦证券英属维京群岛有限公司董事，富邦期货股份有限公司董事，台湾证券交易所股份有限公司董事，北京方正富邦创融资产管理有限公司董事，富邦证券(香港)有限公司董事长，富邦资产管理股份有限公司董事，富邦基金管理(香港)有限公司董事长。

胡德兴先生，董事，硕士。曾任台湾华信证券投资顾问股份有限公司研究员、襄理、副理，

摩根证券投资顾问股份有限公司经理、董事长兼总经理，摩根证券投资信托股份有限公司协理、副总经理，富邦证券投资顾问股份有限公司董事长，富邦康宏资产管理(香港)有限公司董事。现任富邦证券投资信托股份有限公司董事长，富邦康宏资产管理(香港)有限公司董事长，北京方正富邦创融资产管理有限公司董事，基富通证券股份有限公司监察人，富邦基金管理(香港)有限公司董事。

李长桥先生，董事，美国麻省理工学院硕士。曾任 IBM 公司商业咨询顾问主管，国信证券广州分公司投资顾问部总经理，方正证券股份有限公司零售业务部副总经理(主持工作)、零售业务部总经理、零售与互联网金融部总经理(兼)、公司助理总裁，分管财富管理、投资顾问、零售业务、金融科技等业务线。现任方正富邦基金管理有限公司总裁，北京方正富邦创融资产管理有限公司董事长。

邱慈观女士，独立董事，博士。曾任美国加州州立大学圣荷西分校助理教授，美国 CSI 公司研究分析师，台湾中央大学财务金融学系教授。现任上海交通大学上海高级金融学院教授，台湾华通电脑股份有限公司独立董事、审计委员会委员、薪资报酬委员会委员。

祝继高先生，独立董事，博士。曾任对外经济贸易大学国际商学院讲师、副教授。现任对外经济贸易大学国际商学院教授及博士生导师，北京莱伯泰科仪器股份有限公司、中国医药健康产业股份有限公司、青木数字技术有限公司、北京木瓜移动科技股份有限公司独立董事。

李庆民先生，独立董事，博士。曾任吉林建设开发集团公司职员，北京市广盛律师事务所律师，北京市众一律师事务所合伙人及律师，万方城镇投资发展股份有限公司董事及总裁，北京安贞东方医院(筹备)投资总监。现任东方安贞(北京)医院管理有限公司董事。

## 2、基金管理人监事会成员

程明乾先生，监事会主席，硕士。曾任富邦综合证券股份有限公司业务区部部长、资深副总经理、执行副总经理等职务。现任富邦综合证券股份有限公司总经理、董事，富邦期货股份有限公司董事，富邦证券(香港)有限公司董事，富邦证券英属维京群岛有限公司董事，富邦证创业投资股份有限公司董事，富邦闽投创业投资股份有限公司董事，台湾集中保管结算所股份有限公司董事，富邦基金管理(香港)有限公司董事。

雍莘女士，监事，硕士。曾任浙江理工大学经济管理系讲师，方正证券有限责任公司财务管理部总经理，方正证券股份有限公司稽核审计部总经理，方正证券股份有限公司监事会办公室总经理(兼)、行政负责人。现任方正证券股份有限公司监事会主席，方正证券投资有限公司监事、中国民族证券有限责任公司监事会主席，瑞信方正证券有限责任公司监事会主席、湖南方正证券汇爱公益基金会理事长。

毕薇女士，职工监事，学士，EMBA 在读。曾任国金证券营销中心销售总监、人力资源部经理，方正证券人力资源部高级副总裁。2017 年 8 月加入方正富邦基金管理有限公司，曾任人力资源部总监，现任方正富邦基金管理有限公司人力资源部总经理兼综合管理部总经理。

潘英杰先生，职工监事，学士。曾任杭州弘一软件计算机有限公司软件研发部研发工程师，恒生电子股份有限公司基金事业部产品技术经理，泰达宏利基金管理有限公司信息技术部业务分析及项目管理主管，方正富邦基金管理有限公司信息技术部高级经理、副总监、运营总监。现任方正富邦基金管理有限公司信息技术部总经理、北京方正富邦创融资产管理有限公司监事。

## 3、公司高管人员

何亚刚先生，董事长，简历同上。

李长桥先生，总裁，简历同上。

曹磊先生，督察长，学士。曾任湖南电梯厂财务部财务主管、泰阳证券有限责任公司财务

管理部经理助理、稽核审计部初级业务经理、大有期货有限公司财务总监、方正证券股份有限公司法律合规与风险管理部高级经理、总监、副总经理、风险管理部副总经理、董事、执行董事。现任方正富邦基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

王健先生，本科毕业于内蒙古师范大学教育技术专业，硕士毕业于内蒙古工业大学产业经济学专业。2009年3月至2014年12月于包商银行债券投资部担任执行经理助理；2016年6月至2018年2月，于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任助理总监职务；2018年8月至今，于方正富邦基金管理有限公司固定收益基金投资部任副总经理(主持工作)；2015年1月至2015年3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任拟任基金经理；2015年3月至今，任方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场基金的基金经理；2015年3月至2018年2月任方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金经理；2015年6月至2018年8月，任方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月至2017年10月，任方正富邦鑫利宝货币市场基金的基金经理；2017年7月至今，任方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金的基金经理；2017年12月至今，任方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的基金经理；2018年12月至今，任方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年12月至今，任方正富邦丰利债券型证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

主任：李长桥先生，总裁兼权益投资部总经理。

委员：

王健先生，固定收益基金投资部副总经理(主持工作)兼基金经理；

吴昊先生，指数投资部副总经理(主持工作)兼基金经理；

符健先生，研究部副总经理兼基金经理；

杜晓霞女士，交易部代理部门负责人。

6、上述人员之间无近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号

法定代表人：沈仁康

联系人：邵骏超

电话：0571-87659865

传真：0571-88268688

成立时间：1993年04月16日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币18,718,696,778元

存续期间：持续经营

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】91号

基金托管资格批文及文号：《关于核准浙商银行股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》；证监许可【2013】1519号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；

从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。本行经国家外汇管理局批准，可以经营结汇、售汇业务。

## 2、主要人员情况

沈仁康先生，浙商银行党委书记、董事长、执行董事。硕士研究生。沈先生曾任浙江省青田县委常委、副县长，县委副书记、代县长、县长；浙江省丽水市副市长，期间兼任丽水经济开发区管委会党工委书记，并同时担任浙江省丽水市委常委；浙江省丽水市委副书记，期间兼任市委政法委书记；浙江省衢州市委副书记、代市长、市长。

徐仁艳先生，浙商银行党委副书记、执行董事、行长。研究生、高级会计师、注册税务师。徐先生曾任中国人民银行浙江省分行会计处财务科副科长、科长、会计处副处长，中国人民银行杭州中心支行会计财务处副处长、处长，中国人民银行杭州中心支行党委委员、副行长。

## 二、发展概况及财务状况

浙商银行是中国银保监会批准的 12 家全国性股份制商业银行之一，总行设在浙江省杭州市，是唯一一家总部位于浙江的全国性股份制商业银行，2004 年 8 月 18 日正式开业，2016 年 3 月 30 日在香港联交所上市(股份代号：2016)。截至 2018 年末，浙商银行在全国 16 个省(直辖市)和香港特别行政区设立了 242 家分支机构，实现了对长三角、环渤海、珠三角以及部分中西部地区的有效覆盖。2017 年 4 月 21 日，首家控股子公司一浙银租赁正式开业。2018 年 4 月 10 日，香港分行正式开业，国际化战略布局进一步提速。

开业以来，浙商银行立足浙江，稳健发展，已成为一家基础扎实、效益优良、成长迅速、风控完善的优质商业银行。截至 2018 年 12 月 31 日，浙商银行总资产 1.65 万亿元，客户存款余额 9748 亿元，客户贷款及垫款总额 8654 亿元，较上年末分别增长 7.15%、13.26%、28.59%；不良贷款率 1.20%，资产质量保持同业领先水平。在英国《银行家》(The Banker)杂志“2018 年全球银行 1000 强(Top 1000 World Banks 2018)”榜单上，按一级资本位列第 111 位，较上年上升 20 位；按总资产位列第 100 位，较上年上升 9 位。中诚信国际给予浙商银行金融机构评级中最高等级 AAA 主体信用评级。

2018 年，面对严峻复杂的形势，全行紧紧围绕“两最”总目标和全资产经营战略，主动调整优化业务结构，强化合规经营，坚持服务实体经济，严防金融风险，支持金融改革，扎实推进各项工作，保持稳健增长。2018 年本集团实现归属于本行股东的净利润 114.90 亿元，增长 4.94%，平均总资产收益率 0.73%，平均权益回报率 14.17%。营业收入 390.22 亿元，增长 13.89%，其中：利息净收入 263.86 亿元，增长 8.18%；非利息净收入 126.37 亿元，增长 27.99%。营业费用 121.42 亿元，增长 8.58%，成本收入比 29.99%。计提信用减值损失(或资产减值损失)130.30 亿元，增长 38.99%。所得税费用 22.90 亿元，下降 16.23%。

## 三、托管业务部的部门设置及员工情况

浙商银行资产托管部是总行独立的一级管理部门，根据业务条线下设业务管理中心、营销中心、运营中心(外包业务中心)、监督中心，保证了托管业务前、中、后台的完整与独立。截至 2019 年 3 月 31 日，资产托管部从业人员共 37 名。

浙商银行资产托管部遵照法律法规要求，根据业务的发展模式、运营方式以及内部控制、风险防范等各方面发展的需要，制定了一系列完善的内部管理制度，包括业务管理、操作规程、基金会计核算、清算管理、信息披露、内部稽核监控、内控与风险防范、信息系统管理、保密与档案管理、重大可疑情况报告及应急处理等制度，系统性地覆盖了托管业务开展的方方面面，能够有效地控制、防范托管业务的政策风险、操作风险和经营风险。

## 四、证券投资基金托管业务经营情况

中国证监会、银监会于 2013 年 11 月 13 日核准浙商银行开办证券投资基金托管业务，批

准文号：证监许可[2013]1519号。

截至2019年3月31日，浙商银行托管证券投资基金66只，规模合计1429.17亿元，且目前已经与数十家公募基金管理公司达成托管合作意向。

## 五、基金托管人内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，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

浙商银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理的工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、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、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。

### 4、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、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，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 三、相关服务机构

### (一)销售机构及联系人

#### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人的直销中心以及网上交易平台。

#### (1)直销中心

地址：北京市西城区车公庄大街12号东侧8层

邮编：100037

电话：010-57303850、010-57303803

传真：010-57303716

联系人：赵静

客户服务电话：4008180990(免长途话费)

网址：[www.founderff.com](http://www.founderff.com)

## (2)网上交易平台

网上交易平台网址：<https://www.founderff.com/etrading>

投资人可以通过网上交易平台办理本基金的开户、申购等业务。相关业务规则请登录基金管理人网站([www.founderff.com](http://www.founderff.com))查询。

## 2、其他销售机构

### (1)包商银行股份有限公司

注册地址：包头市青山区钢铁大街6号

办公地址：包头市青山区钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

联系人：周雪晴

电话：010-64816038

传真：010-64816038

客服电话：95352

网址：[www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn)

### (2)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：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

联系人电话：021-54509977

客服电话：95021 / 4001818188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

### (3)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼E

联系人：付燊杰

电话：0755-82880158

客服电话：400-804-8688

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

### (4)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层

法定代表人：马勇

客服电话：400-116-1188

联系人：文雯

电话：010-83363101

公司网址：[8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

### (5)济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

传真：010-65330699

网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

(6)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

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

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-36696200

客服电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(7)上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

联系人：许付漪

电话：021-65370077

传真：021-55085991

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(8)浙商银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

办公地址：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

客服电话：95527

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

(9)泉州银行股份有限公司

注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

办公地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

客服电话：400-88-96312 (全国)/96312(福建)

联系人：傅彩芬

电话：0595-22551071

传真：0595-22578871

网址：[www.qzccbank.com](http://www.qzccbank.com)

(10)北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

客服电话：400-159-9288

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

(11)奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客服电话：400-684-0500

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

(12)南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

联系人：张慧

电话：025-66996699

传真：025-66996699

客服电话：95177

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

(13)方德保险代理有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号楼7层711

办公地址：北京市东城区东直门外大街46号12层

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

客服热线：010-64068617

公司网站：[www.fundsure.cn](http://www.fundsure.cn)

(14)泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：徐江

客服电话：400-0411-001

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

(15)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海浦东大道555号裕景国际B座16层

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

联系人：常艳琴

电话：021-20691869

传真：021-20691861

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

(16)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

联系人：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(17)珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔楼 1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(18)北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

客服电话：400-8980-618

联系人：陈霞

电话：010-59313555

网址：[www.chtwm.com](http://www.chtwm.com)

(19)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：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

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008-909-998

联系人：沈晨

电话：010-59336544

传真：010-59336500

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(20)上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客服电话：400-821-0203

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

(21)天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

电话：010-59287105

传真：010-59287825

客服电话：400-111-0889

网址：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(22)东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50588876

客服电话：95531 或 400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(23)北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客服电话：4006199059

联系人：王骁骁

电话：010-56251471

传真：010-62680827

网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(24)凤凰金信(银川)基金销售有限公司

注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房

办公地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层

法定代表人：程刚

客服电话：4008105919

网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(25)长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 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

法定代表人：丁益

客服电话：400-6666-888

传真：0755-83460310

网址：[www.cgws.com/cczq](http://www.cgws.com/cczq)

(26)北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

联系人：陈铭洲

电话：010-65951887

传真：010-65951887

客服电话：400-618-0707

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

**(27)万联证券股份有限公司**

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

电话：020-38286026

客服电话：95322

网址：[wlzq.com.cn](http://wlzq.com.cn)

**(28)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：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

客服电话：400-118-1188

网址：[66liantai.com](http://66liantai.com)

**(29)安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

客服电话：400-8001-001

联系人：郑向溢

电话：0755-82558038

传真：0755-82558355

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

**(30)扬州国信嘉利基金销售有限公司**

注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320

法定代表人：刘晓光

客服电话：4000216088

联系人：苏曦

联系电话：0514-82099618-805

传真：021-68811007

网址：[www.gxjlc.com](http://www.gxjlc.com)

**(31)华瑞保险销售有限公司**

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市浦东区向城路 288 号国华金融大厦 8 楼

法定代表人：路昊

联系人：张爽爽

电话：021-68595976

客服电话：4001115818

网址: [www.huaruisales.com](http://www.huaruisales.com)

(32)联讯证券股份有限公司

注册地址: 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

法定代表人: 徐刚

联系人: 彭莲

联系电话: 13480169928

客服电话: 95564

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

(33)深圳盈信基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1(811-812)

办公地址: 辽宁省大连市中山区海军广场街道人民东路 52 号民生金融中心 22 楼盈信基金

法定代表人: 苗宏升

联系人: 王清臣

电话: 13522300698

传真: 0411-62623236

客服电话: 4007-903-688

网址: <http://www.fundying.com>

(34)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 40-42 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人: 姜昧军

联系人: 王雯

联系电话: 0755-83199599

客服电话: 4008323000

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

(35)泰信财富基金销售有限公司

注册地址: 北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间

办公地址: 北京市朝阳区建国路甲 92 号世贸大厦 c-12

法定代表人: 张虎

联系人: 李丹

客服电话: 400-004-8821

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

(36)浦领基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人: 聂婉君

联系人: 李艳

电话: 010-59497361

传真: 010-64788016

客服电话: 400-876-9988

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

(37)江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址: 江苏省南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址: 江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

联系人：孙平

联系电话：025-6604-6166

客服电话：025-66046166

公司网址：www.huilinbd.com

(38)嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

联系人：李雯

联系电话：010-60842306

传真：010-65185678

网址：www.harvestwm.cn

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)登记机构

名称：方正富邦基金管理有限公司

住所：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层

法定代表人：何亚刚

电话：010-57303985

传真：010-57303716

联系人：郭宇前

#### (三)律师事务所和经办律师

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

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼和 16 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

#### (四)会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

负责人：曾顺福

联系人：杨婧

联系电话：021-61418888

传真电话：021-63350003

经办注册会计师：杨丽、杨婧

#### 四、基金的名称

本基金名称：方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金类型：债券型基金

## 六、基金的投资目标

在控制投资风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单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的相关规定)。

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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的**80%**；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的**5%**，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

### (一)投资策略

本基金在有效风险管理的基础上，通过自上而下的宏观研究和自下而上的证券研究，充分使用积极投资、数量投资、无风险套利等有效投资手段，努力为投资者提供好的回报。

#### 1、资产配置策略

资产配置层面主要通过对宏观经济、市场利率、债券供求、申购赎回现金流情况等因素的综合分析，决定债券、现金等资产的配置比例，并确定债券组合的久期。

#### 2、债券投资策略

##### (1)固定收益资产配置

本基金通过主动跟踪分析国内外宏观经济数据，包括 OECD 领先指标、PMI、国内生产总值、工业增长、固定资产投资、CPI、PPI、进出口贸易等，判断宏观经济运行趋势及在经济周期中所处的位置，预测国家货币政策、财政政策走向，据此判定组合久期和信用资产的战略配置取向。

同时密切跟踪、关注货币金融指标(包括货币供应量 M1/M2，新增贷款、新增存款、准备金率等)，资金和债券的短期供求变化、市场预期等，对于战略配置相应的进行战术性调整。

##### (2)组合久期配置策略

本基金通过对宏观经济形势、财政及货币政策、利率环境、债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益曲线可能移动的方向和方式，并据此确定收益投资资产组合的平均久期。原则上，利率处于上行通道时，缩短目标久期；利率处于下降通道时，则延长目标久期。当利率上升至长期顶部区域时，择机延长久期，当利率下降至长期底部区域时，择机降低久期。

##### (3)期限结构配置策略

本基金在确定固定收益组合平均久期的基础上，对债券市场收益率期限结构进行分析，考虑封闭期内长期、中期和短期债券的相对投资价值，并比较期间的总回报率和波动率，择机采用包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等方式，在长期、中期和短期债券间进行调整，以从收益曲线的变形和不同期限债券价格的相对变化中获利，在最大化骑乘收益的同时，控制组合的波动率和集中度。

#### (4)信用债券配置策略

信用品种的投资收益的主要可分解为利率品种基准收益与信用利差。信用利差是信用产品相对国债、央行票据等利率产品获取较高收益的来源。信用利差主要受两方面的影响，一方面为债券所对应的行业和信用等级市场平均信用利差水平，另一方面为发行人本身的信用状况。信用品种投资策略具体为：

①在经济上行周期，信用利差通常会缩小；反之在下行阶段，信用利差通常会扩大，利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会；同时，研究不同行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定不同行业总体信用风险的利差水平的变动情况，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；

②信用产品发行人的资信水平和评级调整变化会使产品的信用利差扩大或缩小，本基金选择评级有上调可能的信用债；规避有下调可能的信用债，以获取因信用利差下降带来的价差收益；

③对信用利差期限结构进行研究，分析各期限信用债利差水平相当历史平均水平所处的位置，以及不同期限之间利差的相当水平，发现更具投资价值的期限进行投资；

④研究分析相同期限但不同信用评级债券的相对利差水平，发现偏离均值较多，相对利差有收窄可能的债券。

#### (5)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。

#### (6)中小企业私募债券配置策略

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、经营稳定性较差、信用基本面波动性较高的影响，整体的信用风险相对较高。针对中小企业私募债券的这两个特点，本基金在投资过程中，应采取以精选个券，买入并中长线持有收息的投资策略。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经济基本面，确定安全边际，并综合考虑信用评级、债券收益率、市场供求和流动性等要素，确定最终的投资品种。本基金将根据基金存续时间和市场状况，适当控制该类债券占基金净资产的比例，对于有风险隐患的个券，或者基于流动性风险的考虑，本基金将及时减仓或卖出。

#### (7)资产支持证券的投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产

#### (8)个券挖掘策略

本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它产品，本基金将以谨慎为原则，在充分评估风险和收益的基础上，履行必要的程序后进行投资风险管理。

## (二)投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1)本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；
- (2)本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3)本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- (6)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

- (7)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (9)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (10)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (11)本基金投资于中小企业私募债券比例合计不高于基金资产的 10%；
- (12)基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
- (13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (14)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (15)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(13)、(14)项以外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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，但需提前公告，不需要再经基金份额持有人大会审议。

### 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (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)买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

- (5)向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6)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;
- (7)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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本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或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率

中债综合全价(总值)指数是中央国债登记结算有限责任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，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、企业债券、中期票据、短期融资券、公司债等组成。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能客观合理地反映本基金风险收益特征。

若未来法律法规发生变化，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，或者本基金业绩比较基准停止发布，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在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，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险的产品。

## 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据基金合同规定，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 2019 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

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	基金投资	--	--
---	------	----	----

3	固定收益投资	901,929,000.00	97.64
---	--------	----------------	-------

	其中：债券	901,929,000.00	97.64
--	-------	----------------	-------

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 709,155.11 0.08  
 8 其他资产 21,065,916.88 2.28  
 9 合计 923,704,071.99 100.00

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投资。

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投资。

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 94,113,000.00 10.48  
 2 央行票据 --  
 3 金融债券 662,366,000.00 73.75  
 其中：政策性金融债 662,366,000.00 73.75  
 4 企业债券 --  
 5 企业短期融资券 --  
 6 中期票据 --  
 7 可转债(可交换债) --  
 8 同业存单 145,450,000.00 16.19  
 9 其他 --  
 10 合计 901,929,000.00 100.42

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(元) 占基金资产净值比例(%)

1 170215 17 国开 15 1,000,000 102,650,000.00 11.43  
 2 180208 18 国开 08 1,000,000 102,140,000.00 11.37  
 3 120411 12 农发 11 1,000,000 100,370,000.00 11.18  
 4 111872655 18 龙江银行 CD162 1,000,000 97,510,000.00 10.86  
 5 170210 17 国开 10 800,000 80,920,000.00 9.01

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名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  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

(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。

(2)本报告期末持有股票。

(3)期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	-
---	-------	---

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	21,063,320.85
---	------	---------------

5	应收申购款	2,596.03
---	-------	----------

6	其他应收款	-
---	-------	---

7	待摊费用	-
---	------	---

8	其他	-
---	----	---

9	合计	21,065,916.88
---	----	---------------

(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投资。

(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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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。

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。

本基金合同生效日 2016 年 12 月 19 日，基金业绩数据截至 2019 年 3 月 31 日。

#### 方正富邦惠利纯债 A

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

2016/12/19-2016/12/31 0.10% 0.02% 0.75% 0.16% -0.65% -0.14%

2017/1/1-2017/12/31 -0.18% 0.20% -3.38% 0.06% 3.20% 0.14%

2018/01/01-2018/12/31 7.10% 0.09% 4.79% 0.07% 2.31% 0.02%

2019/01/01-2019/03/31 0.86% 0.07% 0.47% 0.05% 0.39% 0.02%

自基金合同生效日(2016/12/19)-2019/03/31 7.94% 0.15% 2.48% 0.07% 5.46% 0.08%

#### 方正富邦惠利纯债 C

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

2016/12/19-2016/12/31 0.09% 0.02% 0.75% 0.16% -0.66% -0.14%

2017/1/1-2017/12/31 20.85% 1.34% -3.38% 0.06% 24.23% 1.28%

2018/01/01-2018/12/31 8.87% 0.14% 4.79% 0.07% 4.08% 0.07%

2019/01/01-2019/03/31 0.84% 0.07% 0.47% 0.05% 0.37% 0.02%

自基金合同生效日(2016/12/19)-2019/03/31 32.79% 0.89% 2.48% 0.07% 30.31% 0.82%

### 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、基金销售服务费
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 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、基金相关账户的开户及维护费用；
- 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 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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，次月前 5 个工作日内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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，于次月前 5 个工作日内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、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构，专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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项纳税主体，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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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：

### 章节 主要更新内容

重要提示 更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据和净值表现的截止日期。

第三部分、基金管理人 更新了本基金管理人的相关信息。

第四部分、基金托管人 更新了本基金托管人的相关信息。

第五部分、相关服务机构 更新了本基金销售机构、律师事务所和经办律师以及会计师事务所和经办注册会计师的相关信息。

第九部分、基金的投资 更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

第十部分、基金的业绩 更新了本基金最近一期基金业绩数据。

第二十一部分、对基金份额持有人的服务 更新了交易资料的寄送方式。

第二十二部分、其他应披露事项 披露了自 2018 年 12 月 20 日至 2019 年 6 月 19 日期间本基金的公告信息。

方正富邦基金管理有限公司

二〇一九年八月二日