

## 国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 10 月 26 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1713 号）注册并进行募集。本基金的基金合同于 2018 年 11 月 30 日生效。本基金为契约型开放式基金。

### 重要提示

国寿安保基金管理有限公司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准予注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金的基金合同于 2018 年 11 月 30 日生效。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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换公司债、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、国债期货，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）。

本基金不投资股票、权证，因持有可转换债券转股所形成的股票（包括因持有该股票所派发的权证）和因投资可分离债券而产生的权证，本基金将在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。

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。

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%，每个交易日日终在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。

本基金为债券型基金，其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中低预期收益/风险品种。本基金的投资范围包括中小企业私募债，该类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，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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，并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、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、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等。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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

基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11、12 层

法定代表人：王军辉

设立日期：2013 年 10 月 29 日

注册资本：12.88 亿元人民币

存续期间：持续经营

客户服务电话：4009-258-258

联系人：耿馨雅

国寿安保基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准设立。公司股东为中国人寿资产管理有限公司，持有股份 85.03%；AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（安保资本投资有限公司），持有股份 14.97%。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

王军辉先生，董事长，博士。曾任嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理兼投资部总监、投资决策委员会执行委员，中国人寿资产管理有限公司总裁助理、副总裁、党委委员，国寿投资控股有限公司总裁、党委书记。现任中国人寿保险（集团）公司首席投资官，中国人寿资产管理有限公司总裁、党委书记，国寿安保基金管理有限公司董事长，中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事长。

宋子洲先生，董事，本科。曾任中国人寿保险公司资金运用中心副总经理，并曾在中央国家机关和中国外贸运输（集团）公司工作。现任中国人寿资产管理有限公司党委委员、副总裁、中国保险资产管理业协会副会长、东吴证券股份有限公司董事。

左季庆先生，董事，硕士。曾任中国人寿资金运用中心债券投资部总经理助理，中国人寿资产管理有限公司债券投资部总经理助理、总经理，中国人寿资产管理有限公司固定收益部总经理，并担任中国交易商协会债券专家委员会副主任委员；现任国寿安保基金管理有限公司总经理、国寿财富管理有限公司董事长。

叶蕾女士，董事，硕士。曾任中华全国工商业联合会国际联络部副处长；现任澳大利亚安保集团北京代表处首席代表、中国人寿养老保险股份有限公司董事、国寿财富管理有限公司董事。

罗琦先生，独立董事，博士。曾任武汉造船专用设备厂助理经济师，华中科技大学管理学院讲师、博士后，武汉大学经济与管理学院金融系副教授。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师，《经济评论》副主编，教育部新世纪优秀人才支持计划入选者，南昌农商银行独立董事，深圳财富趋势科技股份有限公司独立董事。

杨金观先生，独立董事，硕士。曾任中央财经大学教务处处长、会计学院党总支书记兼副院长；现任中央财经大学会计学院教授。

周黎安先生，独立董事，博士。曾任北京大学光华管理学院副教授；现任北京大学光华管理学院应用经济系主任、教授。

### 2、基金管理人监事会成员

杨建海先生，监事长。曾任中国人寿保险公司办公室综合处副处长，中国人寿保险（集团）公司办公室总务处处长，中国人寿资产管理有限公司办公室副主任、监审部副总经理（主持工作），中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表监事、监审部总经理、办公室主

任；现任中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总经理。

张彬女士，监事，硕士。曾任毕马威华振会计师事务所审计员、助理经理、经理、高级经理及部门负责人；现任国寿安保基金管理有限公司合规管理部总经理。

马胜强先生，监事，硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司人力资源部助理、业务主办；现任国寿安保基金管理有限公司综合管理部助理。

### 3、基金管理人高级管理人员

王军辉先生，董事长，博士。简历同上。

左季庆先生，总经理，硕士。简历同上。

申梦玉先生，督察长，硕士。曾任中国人寿保险公司资金运用中心基金投资部副总监，中国人寿资产管理有限公司交易管理部高级经理，中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部副总经理（主持工作）；现任国寿安保基金管理有限公司督察长，国寿财富管理有限公司董事。

石伟先生，资产配置总监，学士。曾任兴全基金公司固定收益首席投资官兼固收总监、中国人寿资产管理有限公司固定收益部副总经理（主持工作）；现任国寿安保基金管理有限公司资产配置总监及投资管理二部总经理。

张琦先生，股票投资总监，硕士。曾任中银基金管理有限公司基金经理、基金经理助理；现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监及基金经理。

董瑞倩女士，固定收益投资总监，硕士。曾任工银瑞信基金管理有限公司专户投资部基金经理，中银国际证券有限责任公司定息收益部副总经理、执行总经理；现任国寿安保基金管理有限公司固定收益投资总监、投资管理部总经理及基金经理。

王文英女士，总经理助理，硕士。曾任中国人寿保险股份有限公司财务主管，中国人寿资产管理有限公司财务会计经理，国寿安保基金管理有限公司综合管理部副总经理、总经理；现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理、综合管理部总经理。

王福新先生，总经理助理，博士后。曾任中国海洋大学教师、大公国际资信评估有限公司金融机构部副总经理、中国人民财产保险股份有限公司博士后工作站研究员，中国人寿保险股份有限公司内控合规部高级主管、投资管理部评估分析处经理、人民币投资管理处高级经理、委托投资管理一处资深经理；现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

王大朋先生，总经理助理，硕士 MBA。曾任华安基金管理有限公司零售业务总部总经理、上海丰佳集团罗马尼亚 EVERFRESH 公司总经理、巨田证券有限公司客户部职员。现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

### 4、本基金基金经理

李一鸣女士，硕士。曾任中银国际定息收益部研究员、中信证券固定收益部研究员，2013年11月加入国寿安保基金，历任基金经理助理、基金经理。2015年1月起任国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金基金经理。2016年5月起任国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金经理。2016年9月起任国寿安保安康纯债债券型证券投资基金基金经理。2016年10月起任国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年2月起担任国寿安保稳嘉混合型证券投资基金基金经理。2017年8月起担任国寿安保稳寿混合型证券投资基金基金经理，2018年11月起任国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金基金经理。

黄力先生，硕士。2010年起任中国人寿资产管理有限公司固定收益部研究员，从事债券投资、研究、交易等工作。2013年加入国寿安保基金管理有限公司，2014年1月至2018年4月任国寿安保货币市场基金基金经理，2015年9月起任国寿安保增金宝货币市场基金基金经理，2017年11月起任国寿安保安裕纯债半年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2017年12月起任国寿安保安盛纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年12月起任国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金基金经理，2019年1月起任国寿安保尊荣中短债债券型证券投资基金基金经理，2019年2月起任国寿安保泰和纯债债券型证券投资基金基金经理。

## 5、投资决策委员会成员

张琦先生：国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监。

董瑞倩女士：国寿安保基金管理有限公司固定收益投资总监、投资管理部总经理。

段辰菊女士：国寿安保基金管理有限公司研究部总经理。

黄力先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。

桑迎先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。

## 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：高国富

成立时间： 1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 293.52 亿元人民币

存续期间： 持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人： 胡波

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

高国富，男，1956 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、

国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2019 年 3 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 4614.20 亿元，比去年末增加 9.52%。托管证券投资基金共一百五十六只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、华富保本混合型证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资

资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫珏主题轮动混合基金、中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安大华惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金等。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、直销机构

###### (1) 国寿安保基金管理有限公司直销中心

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号

法定代表人：王军辉

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11、12 层

客户服务电话：4009-258-258



传真：010-50850777

联系人：孙瑶

(2) 国寿安保基金管理有限公司网上直销交易系统

(<https://e.gsfunds.com.cn/etrading/>)

## 2、其他销售机构

(1) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：汤俊劼

电话：0755-22168301

传真：0755-82080386

客户服务电话：95511-3

网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本基金，并及时公告。

(二) 登记机构

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号

办公地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11、12 层

法定代表人：王军辉

客户服务电话：4009-258-258

传真：010-50850966

联系人：干晓树

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：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

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

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：范新紫

经办注册会计师：黄悦栋、郭燕、范新紫、张小东、范玉军、夏欣然

四、基金的名称

国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金

五、基金的类型

## 债券型

### 六、基金的投资目标

本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。

### 七、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，包括债券（包括国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换公司债、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、国债期货，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）。

本基金不投资股票、权证，因持有可转换债券转股所形成的股票（包括因持有该股票所派发的权证）和因投资可分离债券而产生的权证，本基金将在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。

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。

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%，每个交易日日终在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。

### 八、投资策略

本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略、回购套利策略等投资管理手段，对债券市场及债券收益率曲线的变化进行预测，相机而动、积极调整。

#### （一）债券投资策略

##### 1、类属资产配置策略

本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，判断证券市场对上述变量和政策的反应，并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数。

## 2、期限结构策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。

在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略。

## 3、久期调整策略

本基金将根据中长期内的宏观经济波动趋势，形成对未来市场利率变动方向的预期，在一定范围内适当对资产组合久期进行动态调整。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以增强投资组合收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌带来的风险。

## 4、个券选择策略

本基金将利用公司内部信用评级体系，对债券发行主体所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息进行深入研究并及时跟踪。在此基础上，结合债券发行具体条款，对债券的收益性、安全性、流动性等因素进行分析。同时参考债券外部评级，对债券发行人和债券的信用风险细致甄别，做出综合评价，并着重挑选资质良好及信用评级被低估的券种进行投资。

## 5、分散投资策略

本基金将适当分散行业选择和个券配置的集中度，以降低个券及行业信用事件给投资组合带来的冲击。

## 6、回购套利策略

回购套利策略是本基金重要的操作策略之一，把信用产品投资和回购交易结合起来，管理人根据信用产品的特征，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来博取超额收益，或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。

## 7、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过中小企业私募债券进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险

控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## 8、可转换债券投资策略

可转换债券具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本面优良、具有较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

## 9、证券公司短期公司债券投资策略

基于控制风险需求，本基金将综合研究及跟踪证券公司短期公司债券的信用风险、流动性风险等方面的因素，适当投资证券公司短期公司债券。

### （二）资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

### （三）国债期货投资策略

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的。本基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中债综合（全价）指数收益率。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映中国债券市场总体走势的代表性指数。该指数的样本券覆盖我国银行间市场和交易所市场，成份债券包括国债、央行票据、金融债、企业债券、短期融资券等几乎所有债券种类，具有广泛的市场代表性。全价指数是以债券全价计算的指数值，债券付息后利息不再计入指数之中。

本基金的业绩比较基准根据本基金投资风格和策略特点设置，能够准确反映本基金的风险收益特征，便于基金管理人合理衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其预期收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低预期收益/风险品种。

## 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。

基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的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,报告期间为 2019 年 1 月 1 日至 3 月 31 日。本报告财务数据未经审计。

### 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 4,554,216,844.10 97.59

其中:债券 4,554,216,844.10 97.59

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 19,980,357.18 0.43

8 其他资产 92,303,153.61 1.98

9 合计 4,666,500,354.89 100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资 明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(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 4,554,216,844.10 131.44

其中：政策性金融债 4,554,216,844.10 131.44

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 --

9 其他 --

10 合计 4,554,216,844.10 131.44

#### 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	150415	15 农发 15	5,500,000	556,105,000.00	16.05
---	--------	----------	-----------	----------------	-------

2	050223	05 国开 23	5,000,000	506,400,000.00	14.62
---	--------	----------	-----------	----------------	-------

3	160206	16 国开 06	3,500,000	350,210,000.00	10.11
---	--------	----------	-----------	----------------	-------

4	150220	15 国开 20	3,000,000	302,580,000.00	8.73
---	--------	----------	-----------	----------------	------

5	170407	17 农发 07	2,400,000	243,192,000.00	7.02
---	--------	----------	-----------	----------------	------

#### 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。

#### 10、投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

（2）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之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,557.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	92,287,576.06
5	应收申购款	20.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,303,153.61

#### （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，也并不存在流通受限的情况。

#### （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。

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

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



2018/11/29-2018/12/31 0.56% 0.05% 0.73% 0.06% -0.17% -0.01%  
2019/1/1-2019/3/31 1.12% 0.03% 0.47% 0.05% 0.65% -0.02%  
2018/11/29-2019/3/31 1.69% 0.04% 1.21% 0.06% 0.48% -0.02%

### 十三、费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、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) 账户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。

##### 2、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，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 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 0.10% 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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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“1、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，由基金托管人从基金财产中支付。

## （二）与基金销售有关的费用

1、申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。本基金申购费率随申购金额的增加而递减，适用以下前端收费费率标准：

申购金额（元） 申购费率

M < 100 万 0.80%

100 万 ≤ M < 300 万 0.50%

300 万 ≤ M < 500 万 0.30%

M ≥ 500 万 按笔收取，1000 元/笔

注：M 为申购金额。

投资者在一天之内多次申购的，需按单一交易账户当日累计申购金额对应的费率计算申购费用。

2、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，赎回费全额归入基金财产。

持有期限（Y） 赎回费率

Y < 7 日 1.50%

7 日 ≤ Y < 30 日 0.10%

Y ≥ 30 日 0%

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率。

### （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。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2018 年 11 月 23 日刊登的本基金原招募说明书（《国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“第三部分、基金管理人”中，更新了基金管理人国寿安保基金管理有限公司的主要人员情况、本基金基金经理；
- 2、在“第四部分、基金托管人”中，更新了基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的相关情况；
- 3、在“第五部分、相关服务机构”中，更新了基金份额发售机构的情况和审计基金财产的会计师事务所的情况；
- 4、在“第六部分、基金的募集”中，删除了相关募集方案，增加了基金的募集情况说明；
- 5、在“第七部分、基金合同的生效”中，删除了基金的备案条件和募集失败内容，增加了基金合同生效日期；
- 6、在“第八部分、基金份额的申购与赎回”中，更新了申购赎回开始的日期；
- 7、在“第九部分、基金的投资”中，增加了“八、基金的投资组合报告”，数据内容截止时间为 2019 年 3 月 31 日，财务数据未经审计；
- 8、增加了“第十部分、基金的业绩”，相关数据内容截止时间为 2019 年 3 月 31 日；
- 9、增加了“第二十二部分、其它应披露的事项”，披露了报告期内我公司在指定信息披露媒体上披露的与本基金相关的所有公告。

国寿安保基金管理有限公司

2019年7月12日