

国开泰富基金管理有限责任公司

国开泰富睿富债券型证券投资基金 更新招募说明书（摘要） （2019 年第 1 号）

基金管理人：国开泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

二〇一九年八月

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。

【重要提示】

国开泰富睿富债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2017 年 7 月 18 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2017】1277 号文准予募集注册，本基金基金合同于 2018 年 12 月 19 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《国开泰富睿富债券型证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益及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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险；交易对手违约风险；连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形时基金管理人将依基金合同约定提前终止基金合同的风险；投资本基金特有的其他风险等等。本基金的目标客户不包括特定机构投资者。

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金，属于中低风险、中低预期收益的证券投资基金品种。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其

他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年6月19日（特别事项注明除外），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：国开泰富基金管理有限责任公司

住所：北京市怀柔区北房镇幸福西街3号416室

办公地址：北京市西城区西直门南小街国英园9号楼

邮政编码：100035

法定代表人：郑文杰

设立日期：2013年7月16日

组织形式：有限责任公司

注册资本：3.6亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：邓彬

电话：010-59363299

传真：010-59363298

国开泰富基金管理有限责任公司经中国证监会证监许可[2013]850号文批准设立。公司的股权结构如下：国开证券股份有限公司，66.7%；国泰证券投资信托股份有限公司，33.3%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

公司日常经营由总经理负责。公司根据经营运作需要设置董事会办公室、综合管理部、市场部、固定收益投资部、权益投资部、专户投资部、研究部、交易部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部（法律合规部）、信息技术部、财务部，共十三个职能部门。此外，公司还设有投资决策委员会和风险控制委员会。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

郑文杰先生，董事长，金融硕士。国开证券股份有限公司党委副书记、总裁；曾任职于国家开发银行业务发展局、新疆分行、评审管理局、统计局及总参兵种部，长期在银行、证券等金融行业从事管理工作。

张锡先生，董事，管理学硕士。台湾国泰证券投资信托股份有限公司董事长，常年在台湾地区金融机构从事基金投资和管理工作经验，经验丰富。

孟天山先生，董事，金融博士。国开证券股份有限公司副总裁。曾在国开金融有限责任公司和国家开发银行从事投资和管理等工作，经验丰富。

杨波先生，董事，工学硕士。国开泰富基金管理有限责任公司总经理。曾任职泰康资产管理有限责任公司金融机构部总经理，曾就职于中信证券股份有限公司资产管理部。拥有丰富的资产管理经验。

张雍川先生，董事，经济学硕士。台湾国泰证券投资信托股份有限公司总经理，具有丰富的投资管理经验。

刘建国先生，董事，经济学硕士。国开证券股份有限公司人力资源部总经理。曾在国家开发银行资金局、财会局、人事局工作，长期从事银行资金管理、人事管理等相关工作。

刘迎生先生，独立董事，法学硕士。江川金融服务股份有限公司董事长，长期从事金融服务和相关法律方面的工作。

李志辉先生，独立董事，经济学博士。南开大学经济学院财金研究所所长、教授、博士生导师，中国金融学会常务理事，长期从事金融研究工作。

张景溢先生，独立董事，管理学博士。联亚光电工业股份有限公司董事长、台虹科技股份有限公司副董事长，长期从事创业投资基金管理工作。

2、监事会成员

廖昶寰先生，监事会主席，经济学硕士。曾任国开证券股份有限公司风险管理部副总经理，曾就职于国家开发银行广西省分行和农业发展银行广西省分行等单位。拥有丰富的金融行业从业和管理经验。

吴惠君女士，监事，经济学硕士。台湾国泰证券投资信托股份有限公司资深副总经理，具有丰富的财务、信息技术、基金运营和销售等方面的管理经验。

李常艳女士，监事，会计学士。曾在中才会计师事务所、光大银行青岛分行、用友金融信息技术股份有限公司从事审计、会计工作，现在国开泰富基金管理有限责任公司财务部工作。

3、高级管理人员

郑文杰先生，董事长。简历同上。

杨波先生，总经理。简历同上。

岳斌女士，督察长，工商管理硕士。曾任国开证券股份有限公司合规法律部总经理、航空证券有限责任公司稽核风控部副总经理及合规部总经理，曾就职于航空信托投资有限责任公司投资部及证券部。具有丰富的合规管理经验。

朱瑜女士，副总经理，工学硕士。曾任国开证券股份有限公司经纪业务部副总经理，曾在国家开发银行山西省分行客户二处工作。具有丰富的金融行业及信息技术管理经验。

何玄文先生，权益投资总监，管理学硕士。曾任职于中信证券股份有限公司、北京乐正资本管理有限公司等公司，先后担任研究员、研究主管、投资经理、权益投资主管、量化投资总监等职务，拥有丰富的研究及投资经验。

马文祥先生，固收投资总监，经济学硕士。曾任长盛基金管理股份有限公司固定收益部副总、公募投资总监，曾任工银瑞信基金管理股份有限公司固定收益部基金经理。拥有丰富的研究及投资经验。

4、基金经理

（1）现任基金经理

王婷婷女士，中央财经大学法律硕士，曾任益民基金管理有限公司益民货币市场基金、益民多利债券混合型证券投资基金基金经理，交易部副总经理；2016年加入国开泰富基金，现任固定收益投资部基金经理。自2018年12月19日起担任本基金基金经理，2017年3月27日起任国开泰富货币市场证券投资基金基金经理，2018年5月30日起任国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

方龙先生，中国社会科学院研究生院经济学博士，曾任职于中国社会科学院金融研究所担任助理研究员，银河期货有限责任公司担任高级研究员，方正证券股份有限公司担任高级经理、量化交易员，九州证券股份有限公司担任量化投资经理。2018年加入国开泰富基金，现任权益投资部基金经理。自2019年4月10日起担任国开泰富睿富债券型证券投资基金基金经理，2019年4月4日起任国

开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

本基金无历任基金经理。

5、投资决策委员会成员的姓名及职务

成员：

杨波先生，总经理。

何玄文先生，权益投资总监。

马文祥先生，固收投资总监。

梁雪丹女士，研究部副总经理。

王婷婷女士，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

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。硕士研究生、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%。

（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）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）国开泰富基金管理有限责任公司直销中心

注册地址：北京市怀柔区北房镇幸福西街 3 号 416 室

办公地址：北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼

法定代表人：郑文杰

成立日期：2013 年 7 月 16 日

联系人：邓彬

电话：010-59363299

传真：010-59363298

（2）国开泰富基金管理有限责任公司网上直销

基金管理人网站：<https://www.cdbsfund.com>

交易网站：<https://etrade.cdbsfund.com/etrade>

联系人：邓彬

电话：010-59363299

传真：010-59363298

2、其他销售机构

（1）中信银行股份有限公司

注册地址：北京东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：林大千

客服电话：95558

网址：www.citicbank.com

（2）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：400-076-6123

网址：www.fund123.cn

（3）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 2-6 层

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：陈共炎

联系人：辛国政

客服电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（4）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号西裙楼

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

客服电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

（5）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 号金座

法定代表人：其实

联系人：潘世友

客服电话：95021/400-181-8188

网址：fund.eastmoney.com

（6）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼 4 楼

法定代表人：吴强

联系人：费超超

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

（7）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

客服电话：400-820-2899

网址：<http://www.erichfund.com>

（8）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：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

联系人：王恕玮

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（9）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401

办公地址：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

法定代表人：江卉

联系人：黄立影

客服电话：个人业务：95118，企业业务：400-088-8816

网址：fund.jd.com

（10）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路689号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号

法定代表人：周杰

联系人：赖奕欣

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

（11）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

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：张志刚

联系人：尹旭航

客服电话：95321

网址：www.cindasc.com

（12）东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：夏锐

客服电话：59309

网址：www.dxzq.net

（13）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

联系人：骆宛

客服电话：400-820-5369

网站：www.jiyufund.com.cn

（14）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市四惠盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

客服电话：4006-802-123

网址：<https://www.zhixin-inv.com>

（15）北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：叶精一

联系人：张林

客服电话：400-066-8586

网站：www.igesafe.com

（16）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋

法定代表人：金佶

联系人：甄宝林

客服电话：400-820-2819

网址：www.huifu.com

（17）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 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

（18）上海联泰基金销售有限公司

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 号楼 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：兰敏

客服电话：400-166-6788

网址：www.66liantai.com

（19）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 102 号 708 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：陈达伟

联系人：孟召社

客服电话：021-58373599

网址：www.dtfunds.com

（20）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

客服电话：4008-215-399

网址：www.noah-fund.com

（21）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

法定代表人：洪弘

联系人：文雯

客服电话：400-166-1188

网址：www.xinlande.com.cn

（22）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市安苑路11号邮电新闻大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：李露平

客服电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

（23）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

客服电话：4006-788-887

网址：www.jjmmw.com；www.zlfund.cn

（24）北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

联系人：许爽

客服电话：010-58170761

网址：www.shengshiview.com

（25）中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

法定代表人：弭洪军

联系人：郭斯捷

客服电话：400-876-5716

网址：<https://www.cmiwm.com>

（26）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号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1号

法定代表人：钱燕飞

联系人：王峰

客服电话：95177

网址：www.snjjin.com

（27）国开证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街29号1-9层

办公地址：北京市西城区阜成门外大街29号1-9层

法定代表人：张宝荣

联系人：王昊国

客服电话：400-889-5593

网址：www.gkzq.com.cn

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

（二）登记机构

名称：国开泰富基金管理有限责任公司

注册地址：北京市怀柔区北房镇幸福西街3号416室

办公地址：北京市西城区西直门南小街国英园9号楼

法定代表人：郑文杰

联系人：姚劼

电话：010-59363299

传真：010-59363298

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：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：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：程红粤

经办注册会计师：张勇、程红粤

四、基金的名称

国开泰富睿富债券型证券投资基金

五、基金运作方式

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在适度承担风险并保持资产流动性的基础上，通过配置债券等金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资股票力争获取增强型回报。

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，包括国内依法发行上市的企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离债券）、金融债、央行票据、国债、资产支持证券、短期融资券和债券回购，国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）和权证，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相关规定）。

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。

本基金投资组合资产配置比例：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 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、基金的投资策略

本基金将在资产配置策略的基础上，通过债券投资策略构筑债券组合的平稳收益，通过积极的股票投资策略追求基金资产的增强型回报。

（一）资产配置策略

本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。

本基金将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票一级市场和二级市场的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度的参与权益类资产配置，把握市场时机力争为基金资产获取增强型回报。

（二）债券投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。

1、久期配置策略

本基金认真研判中国宏观经济运行情况，及由此引致的货币政策、财政政策，密切跟踪CPI、PPI、M2、M1、汇率等利率敏感指标，通过定性与定量相结合的方式，对未来中国债券市场利率走势进行分析与判断，并由此确定合理的债券组合久期。

2、期限结构配置策略

本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。

在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线

变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。

3、信用类债券策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。

本基金对于金融债、信用等级为投资级的企业（公司）债等信用类债券采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过内部的信用分析方法对可选债券品种进行筛选过滤。

4、息差策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将融入的资金投资于信用债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购率）的套利价值。

5、可转换债券投资策略

本基金的可转换债券的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法。本基金管理人行业研究员对可转换债券发行人的公司基本情况进行深入研究，对公司的盈利和成长能力进行充分论证。在对可转债的价值评估方面，由于可转换债券内含权利价值，本基金将利用期权定价模型等数量化方法对可转换债券的价值进行估算，选择价值低估的可转换债券进行投资。

（三）资产支持证券投资策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

（四）股票投资策略

股票投资在资产配置策略的基础上，将采取行业配置与个股精选相结合的投资策略。

1、行业配置

本基金将密切关注国内外经济运行情况、国内财政政策和产业政策等政策取向，深入分析国民经济各行业的发展现状及政策影响，并结合行业景气分析，对具有良好发展前景特别是国家重点扶植的行业进行重点配置。

2、个股精选策略

上市公司持续的现金收益和盈利的稳定增长前景是股价上涨的长期内在推动力。本基金在个股选择中将坚持价值投资理念，理性地分析中国证券市场的特点和运行规律，用产业投资眼光，采用长期投资战略，辅以金融工程技术，发掘出价值被市场低估的，具有长期增长能力的公司的股票，买入并长期持有，将中国经济长期增长的潜力最大程度地转化为投资人的长期稳定收益。

（五）权证投资策略

为实现基金投资目标，在有效控制风险的前提下，本基金还将在法规和基金合同允许的范围内并基于谨慎原则适度进行权证投资。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。

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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。沪深 300 指数是沪深证券交易所于 2005 年 4 月 8 日联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。它的编制目标是反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况，并能够作为投资业绩的评价标准，沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场 60%左右的市值，具有良好的市场代表性和可投资性。中债财富指数是以债券全价计算的指数值，同时考虑了利息再投资因素，这类指数在市场上应用最广泛，可用于作为被动型投资组合的跟踪标的，也可作为主动型投资组合的业绩比较基准。总财富指数涵盖了银行间市场不同品种、不同期限债券，覆盖范围广，具有良好的市场代表性。

本基金将在适度承担风险并保持资产流动性的基础上，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。该业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。

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比较基准的指数时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金，属于中低风险、中低预期收益的证券投资基金品种。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月10日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（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

（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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	68,511,867.10	47.04
	其中：债券	68,511,867.10	47.04
	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	25,650,278.48	17.61
	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	48,650,762.26	33.41
8	其他资产	2,825,046.19	1.94
9	合计	145,637,954.03	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

（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

本基金本报告期末未持有股票投资。

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

（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

本基金本报告期末未持有股票投资。

（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	3,513,509.00	2.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,013,600.00	2.98
	其中：政策性金融债	4,013,600.00	2.98
4	企业债券	16,284,349.00	12.10
5	企业短期融资券	27,114,400.00	20.15
6	中期票据	10,053,000.00	7.47
7	可转债（可交换债）	7,533,009.10	5.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,511,867.10	50.92

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

（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	112546	17 万科 01	100,000	10,159,000.00	7.55
2	011802502	18 吉林高速 SCP007	100,000	10,057,000.00	7.48
3	101659038	16 新和成 MTN001	100,000	10,053,000.00	7.47
4	011802138	18 国网租赁 SCP002	100,000	10,049,000.00	7.47
5	011900654	19 国贸地产 SCP002	70,000	7,008,400.00	5.21

（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

本基金在本报告期内未进行贵金属方面的投资。

（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

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

本基金在报告期内未进行国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金在报告期内未进行国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金在报告期内未进行国债期货投资。

（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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,153.80
2	应收证券清算款	1,692,705.11

序号	名称	金额（元）
3	应收股利	-
4	应收利息	1,127,187.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,825,046.19

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	132005	15 国资 EB	576,500.00	0.43
2	113019	玲珑转债	564,850.00	0.42
3	132004	15 国盛 EB	506,349.80	0.38
4	110045	海澜转债	397,358.00	0.30
5	113516	苏农转债	371,220.00	0.28
6	113518	顾家转债	368,490.00	0.27
7	113512	景旺转债	258,340.00	0.19
8	128045	机电转债	234,840.00	0.17
9	113504	艾华转债	227,960.00	0.17
10	110031	航信转债	224,060.00	0.17
11	132013	17 宝武 EB	204,140.00	0.15
12	132015	18 中油 EB	200,940.00	0.15
13	128029	太阳转债	196,501.20	0.15
14	110034	九州转债	160,109.00	0.12
15	110033	国贸转债	121,836.40	0.09
16	113013	国君转债	118,410.00	0.09
17	110043	无锡转债	109,800.00	0.08

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

无。

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。

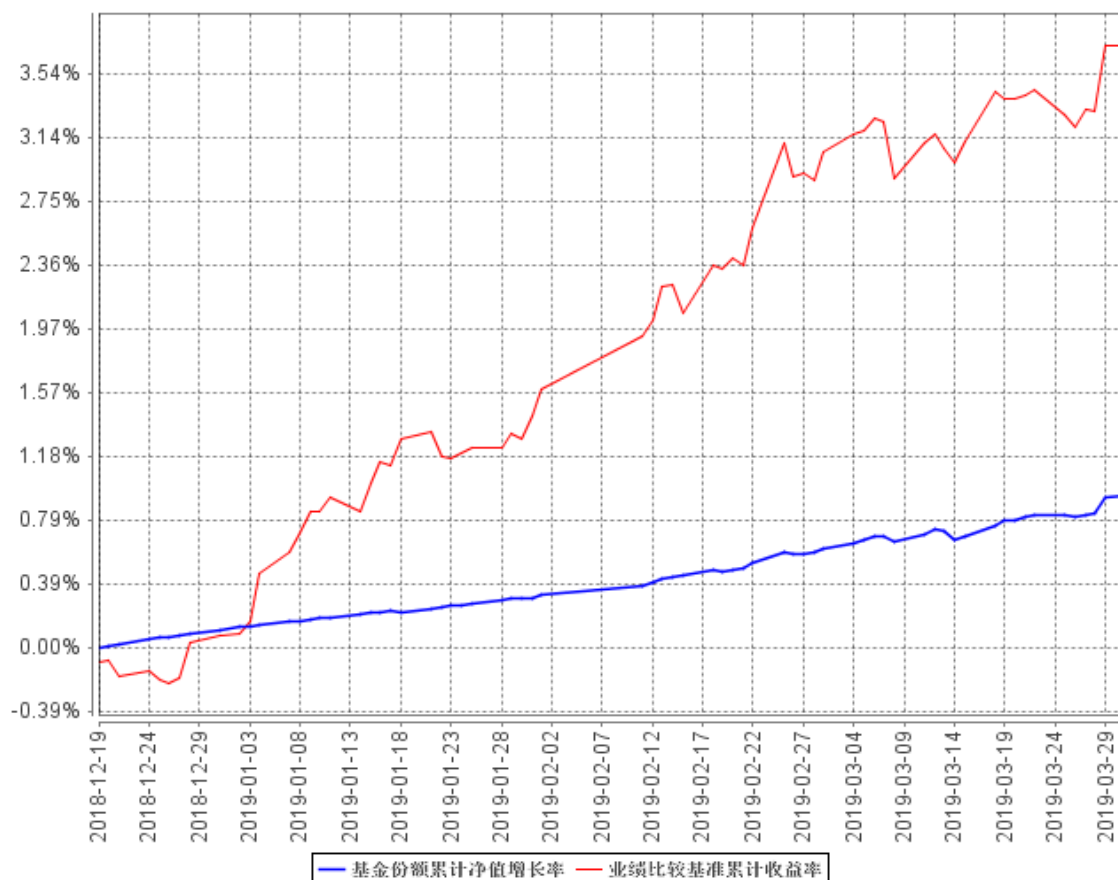
（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2019年1月1日至3月31日	0.82%	0.02%	3.69%	0.15%	-2.87%	-0.13%
自基金合同生效日至2019年3月31日	0.93%	0.02%	3.77%	0.14%	-2.84%	-0.12%

注：中债综合财富指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

（二）自基金合同生效以来基金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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2018年12月19日生效。

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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；

8、基金的账户开户费用、账户维护费用；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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款指令，基金托管人复核后于次月前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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

上述“一、基金费用的种类”中第4—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。

（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。

（五）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人须最迟于新费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。调整基金管理费率、基金托管费率或提高销售服务费率需经基金份额持有人大会决议通过。

十四、对招募说明书更新部分的说明

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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，对本基金管理人主要更新内容如下：

更新：“一、重要提示”

更新：“二、释义”

更新：“三、基金管理人”

更新：“四、基金托管人”

更新：“五、相关服务机构”

更新：“六、基金的募集”

更新：“七、基金合同的生效”

更新：“八、基金份额的申购与赎回”

更新：“九、基金的投资”

更新：“十二、基金的收益与分配”

更新：“十三、基金的费用与税收”

更新：“二十一、其他应披露事项”

国开泰富基金管理有限责任公司

2019年8月3日