

国寿安保尊享债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015年第2号）

国寿安保尊享债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2014年5月14日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准国寿安保尊享债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]480号）注册和2014年6月17日《关于国寿安保尊享债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（证券基金机构监管部函[2014]J535号），进行募集。本基金的基金合同于2014年7月24日正式生效，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注册，并不表明其对本基金的价值和收益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2014年7月24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。基金投资人依据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本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，包括国内依法发行上市的国家债券、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、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、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），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）。本基金不直接参与股票投资，但可持有因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以及因投资可分离债券而产生的权证）。因上述原因持有股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起30个交易日内卖出。

本基金的资产配置比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种。从预期风险和收益方面看，本基金的预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

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，并承担基金投资出现各类风险，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而产生的流动性风险。基金管理人在基金管理人实施过程中产生的基金管理等风险等等。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读产品招募说明书和基金合同，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。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，由投资人自行承担。

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份额并不构成新基金业绩表现的保证。

本基金的基金合同于2014年7月24日生效。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个月的最后一日。本更新招募说明书所载内容截止日为2015年7月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6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：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：刘慧敏
设立日期：2013年10月29日
注册资本：5.88亿元人民币
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
刘志刚先生，董事长，博士。曾任中国证监会办公室副主任，上海证券交易所副总经理、国泰君安证券公司总裁兼副董事长，中国人寿资产管理有限公司副总裁、总裁，现任中国人寿保险（集团）公司副总裁、中国人寿资产管理有限公司总裁、中国人寿富兰克林资产管理有限责任公司董事长。
许舜良先生，董事，博士。曾任农业银行总行信贷部乡镇企业处、综合处、信贷二部副处处长，办公室副主任，主任，农业银行广东省分行副行长、行长、农业银行总行资产处事业部负责人（正局级），特殊资产经营部总经理（正省行级）等。现任中国人寿资产管理有限公司党委委员、副总裁。

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。

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部长；现任澳大利亚保华国际北京代表处首席代表，国寿财富管理有限公司董事。

彭雪峰先生，独立董事，博士。曾任北京市燕山区律师事务所律师，北京市第四律师事务所律师；现任北京大学大成律师事务所律师、律师。

杨金观先生，独立董事，硕士。曾任中央财经大学教授、会计学院副主任、副院长、学校党委书记兼副院长；现任中央财经大学教务处处长、会计学教授。

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，本科。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。现任中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、监审部副主任、办公室主任（党委办公室主任）。

3.高级管理人员
刘慧敏先生，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。

4.本基金基金经理
董瑞倩女士，基金经理，硕士，17年证券从业经验。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固定收益部副总经理，执行总经理；现任国寿安保基金管理有限公司投资管理部副总经理，国寿安保尊享债券型证券投资基金、国寿安保增益信用债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员
左季庆先生：国寿安保基金管理有限公司董事、总经理。
董瑞倩女士：国寿安保基金管理有限公司投资管理部副总经理。

段辰菊女士：国寿安保基金管理有限公司研究部副总经理。
黄力先生：国寿安保基金管理有限公司基金经理。
吴坚先生：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：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟玖佰柒拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元

存续期间：持续经营
基金托管部接触批文及文号：中国证监会证监监字[1998]12号
联系人：田青
联系电话：(010)6759 5096
(二)主要人员情况
赵刚，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部和总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

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

张力伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部，信贷部，信贷管理部，信贷经营

部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，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。
黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行计财部，长期从事托管理务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

三、相关服务机构
(一)基金申购发售机构
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：刘慧敏
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：孙娜
(2)国寿安保基金管理有限公司网上直销系统(https://e.gsfund.com.cn)

2.其他销售机构
(1)中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
电话：010-66276564
联系人：王琳
客服电话：95533
网址：www.ccb.com
(2)中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn
(3)中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
法定代表人：蒋超良
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

(4)交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：裴菲
电话：021-58481234
传真：021-58404843
网址：www.bankcomm.com
(5)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
法定代表人：吉晓辉
联系人：高天、姚辉
电话：021-61618888
传真：021-63604196
客户服务热线：95528
网址：www.spdb.com.cn
(6)江苏张家港农村商业银行股份有限公司
注册地址：江苏省张家港市人民中路66号
办公地址：江苏省张家港市人民中路66号
法定代表人：王自忠
联系人：孙喻
电话：051256981188
传真：05125698259
网址：www.zrcbank.com
(7)申万宏源证券股份有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：钱彦琛
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.swhysc.com

(8)中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
联系人：邵海霞
电话：010-66568124
传真：010-66568990
网址：www.chinastock.com.cn
(9)长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路88号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路88号长江证券大厦
法定代表人：杨泽洋
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务电话：95579
网址：www.95579.com
(10)中山证券有限责任公司
注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新研发大楼7层、8层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新研发大楼7层、8层
法定代表人：黄涛录
联系人：刘军
电话：0755-82943755
传真：0755-82960582
客户服务电话：400-102-2011
网址：www.zszq.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：高冠江
联系人：唐静
电话：010-63801000
传真：010-63800978
客户服务电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

(12)国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号国海大厦
法定代表人：张雅维
联系人：陈琪华
电话：0755-82047857
传真：0755-82835785
客户服务电话：95563
网址：www.gqzq.com.cn
(13)广发证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区河北路183-187号大都会广场43楼
办公地址：广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87555305
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn
(14)中国国际金融有限公司
注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
法定代表人：金立群
联系人：肖婷
电话：010-65051166
传真：010-65058065
客户服务电话：010-85679238；010-85679169
网址：www.cicc.com.cn

(15)齐鲁证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴昊
电话：0531-68891155
传真：0531-68898752
客服电话：95539
网址：www.qlzq.com.cn
(16)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
法定代表人：其实
联系人：丁珊珊
电话：010-65980408-8009
传真：010-65980408-8000
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.fund123.com
(17)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1号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市翠苑路2号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
联系人：杨翼

电话：0571-88911818
传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772
网址：www.tjjin.cn
(19)和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：岳朋
电话：010-85650578
传真：021-20635879
客户服务电话：4009-200-022
网址：www.hexun.com
(20)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五楼大创大厦702室
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪涛
联系人：段颖涛
电话：010-88312877
传真：010-88312885
客户服务电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com
(21)北京中天嘉华基金销售有限公司
注册地址：北京市石景山区八大处高科技园区西井路3号3号楼7457房间
办公地址：北京市朝阳区京顺路5号曙光大厦C座一层
法定代表人：黄俊辉
联系人：张立新
电话：010-58276999
传真：010-58276998
客户服务电话：400-650-9972
网址：www.5iilicai.com
(22)上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张达
电话：021-20613999
传真：021-68959616
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com
(23)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区深南东路5047号发展银行25层L10F
办公地址：深圳市福田区深南东路5047号发展银行25层L10F
法定代表人：薛锋
联系人：董彩珍
电话：0755-33227950
传真：0755-82808798
客户服务电话：400-678-8887
网址：www.zlfund.com、www.jmmw.com
(24)北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民生大厦6层
法定代表人：闫振斌
联系人：韩晓红
电话：010-62020088-7071
传真：010-62020355
客户服务电话：400-888-6661
网址：www.myfund.com
(25)深圳腾元基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808
办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808
法定代表人：曾革
联系人：李梅
电话：0755-33376922
传真：0755-33065116
客户服务电话：400-687-7899
网址：www.tenyuanfund.com
(26)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号楼3楼
法定代表人：燕斌
联系人：汤茜
电话：021-51607071
传真：021-62990063
客服电话：4000-466-788
公司网站：www.91fund.com.cn
(27)深圳市新华德证券咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人：杨懿
联系人：张燕
电话：010-58325388-1588
传真：010-58325300
客服电话：400-166-1188
公司网站：8.jrjicm.com
(28)泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：薛长平
电话：0411-88891212
传真：0411-88891212
客服电话：400-6411-999
公司网站：www.taichengcaifu.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：刘慧敏
客户服务电话：4009-258-258
联系人：于姝静
传真：010-50850966
(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：吕、安冬
经办会计师：李华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大厦17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大厦17层01-12室
法人代表：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：010-58153000
传真：010-85188298
联系人：郝虹
经办注册会计师：郝虹、林美虹

四、基金的名称
国寿安保尊享债券型证券投资基金
五、基金的投资目标
本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，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，包括国内依法发行上市的国家债券、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、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、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），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）。本基金不直接参与股票投资，但可持有因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）以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起30个交易日内卖出。

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和对宏观经济动态跟踪，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、久期投资策略、个券选择策略、分散投资策略、回购套利策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行跟踪、相机调整、积极调整。

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，确定类属资产的最佳权重。

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曲线有一定影响。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。

3.久期调整策略
本基金将根据中长期期的宏观经济趋势，形成对将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；当预期收益率曲线下移时，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，结合债券发行主体条款、对债券的收益率、安全性、流动性等因素进行分析。同时参考外部评级，对债券发行人和债券的信用风险做详细甄别，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赚取超额收益，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.可转换债券投资策略
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，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。本基金将以高流动性可转换债券为股票。

八、中小企业私募债投资策略
本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资。在此基础上重点分析中小企业私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定承销机构所处阶段，研究中小企业私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况。并投资具有积极影响的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对中小企业私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价中小企业私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为中证综合（全价）指数收益率。本基金综合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、短期融资券等几乎所有债券品种，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，债券付息后利息不再计入指数之中。

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，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。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整实施前2个工作日在指定媒体上予以公告，且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预期风险、较低预期收益的品种。本基金债券资产占基金资产的比例不低于80%，不主动参与股票投资。从预期风险和收益方面看，本基金的预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理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2015年6月30日。报告期间为2015年4月1日至6月30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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	48,737,587.16	3.79
2	其中：股票	48,737,587.16	3.79
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	1,155,829,221.50	89.84
5	其中：债券	1,155,829,221.50	89.84
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	46,565,951.92	3.62
12	其他资产	35,373,706.69	2.75
13	合计	1,286,506,437.27	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水务生产和供应业	198.40	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,848,596.00	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术的业	-	-
J	金融业	39,888,762.76	5.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,737,587.16	6.12

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
金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	4,012,954	39,888,762.76	5.01
2	000089	深圳机场	784,540	8,848,596.00	1.11
3	600023	涪陵电力	20	198.40	0.00

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,232,000.00	15.09
4	企业债券	120,232,000.00	15.09
5	企业短期融资券	647,310,784.50	81.25
6	中期票据	330,749,000.00	41.52
7	可转换	57,537,437.00	7.25
8	其他	-	-
9	合计	1,155,829,221.50	145.09

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
金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150203	15国债(3)	500,000	497,350,000.00	6.24
2	140444	14广发44	400,000	401,400,000.00	5.04
3	124428	13粤债(清)	300,000	317,610,000.00	3.99
4	132001	14国债(国)	171,460	173,108,097.80	2.18
5	10146008	14鲁信债MTN001	300,000	31,209,000.00	3.92

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股指期货投资明细
金额单位：人民币元

序号	期货代码	期货名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	IF1509	IF1509	-	-	-
2	IF1512	IF1512	-	-	-
3	IF1603	IF1603	-	-	-
4	IF1606	IF1606	-	-	-
5	IF1609				