

## 国寿安保安享纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

国寿安保安享纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2016年10月19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享纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]4227号)注册并进行募集。本基金的基金合同于2016年10月19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2016年10月19日生效。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会备案。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,应仔细阅读基金合同。

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、地方政府债券、资产支持证券、证券公司短期公司债券、同业存单、债券回购、可分离交易可转债的纯债部分、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)以及法律法规和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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人届时根据相关规定在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。

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%。本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等等。

本基金为债券型基金,预期风险收益水平相应高于货币型基金,低于混合型基金、股票型基金,属于证券投资基金中的中低风险收益/风险品种。

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: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、基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险等等。

投资者申购、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导致的投资风险,由投资人自行承担负责。

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。

本基金的基金合同于2016年10月19日生效。基金招募说明书自基金合同生效之日起,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2018年4月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2018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:上海虹口区东陆路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  
成立日期: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:耿雁华

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1908号文核准设立,基金管理人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(安堡资本管理有限公司),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,安堡资本总裁,中国人寿保险股份有限公司董事长,上海陆家嘴贸易有限公司董事。

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书记、副总裁、中国人寿资产管理股份有限公司副董事长、东吴证券股份有限公司董事。

李季先生,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部长;现任澳大利亚安堡集团北京代表处首席代表、中国人寿养老保险有限公司董事,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,副主任,《经济评论》副主编、教育部金融金融人才支持计划入选者,武汉大学资产管理公司独立董事,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授、会计学院副院长、副教授、学校党支部书记兼校长;现任中央财经大学教务处处长、会计学院院长。

周黎安先生,独立董事,博士。曾任北京光华管理学院副教授;现任北京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纪委副书记、监事会副经理(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、监事会副经理,现任中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表(党委办公室)主任。

张彤女士,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

理部总经理,国寿财富管理有限公司风险控制委员会委员。  
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总监、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。  
李季先生,总经理,硕士。简历同上。  
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、业务助理;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固定收益部副经理、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、投资管理部总监及基金经理。

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经理,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。

封雪梅女士,总经理助理,硕士。曾任中国工商银行股份有限公司经理,大成基金管理公司高级经理,信达澳银基金管理有限公司总经理助理兼机构业务总监;现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

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师,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、综合管理部经理。

4.本基金基金经理  
李一鸣女士,毕业于北京大学,硕士研究生。曾任中银国际固定收益部研究员、中信证券固定收益部研究员,2013年11月加入国寿安保基金。2015年1月起任国寿安保尊益信用纯债一年定期开放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月起任国寿安保安享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月起任国寿安保稳盈混合型证券投资基金基金经理,2017年8月起任国寿安保稳泰混合型证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员  
李季先生: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固定收益投资总监,投资管理部副经理。

段展菊女士:国寿安保基金管理有限公司股票部副经理。  
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。

黄力先生:国寿安保基金管理有限公司基金经理。  
吴昊先生: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)基本情况  
名称:南京银行股份有限公司  
住所:南京市中山路288号  
法定代表人:胡荣光  
成立时间:1996年2月6日  
基金托管业务批准文号:中国证监会证监许可[2014]405号  
组织形式:股份有限公司  
注册资本:848220.7924万元人民币  
存续期间:持续经营

(二)基金托管业务经营情况  
1.托管业务概况  
南京银行成立于1996年2月8日,是一家具有由国有股份、中资法人股份、外资股份及众多个人股份共同组成股权结构的股份有限公司,实行一办法人体制。南京银行历经两次更名,先后于2001年、2005年引入国际康公司和法国巴黎银行入股,在全国城市行中率先启动市辅等程序并于2007年成功上市。目前注册资本共84.82亿元,下辖17家分行,181家营业网点,员工总数8100余人。

南京银行坚持走差异化、特色化、精细化的发展道路,努力做成中小银行中的一流品牌,将中小企业和个人业务作为战略业务重点推进,丰富金融产品体系,倾力满足中小企业和个人融资需求,业务品牌影响力不断扩大。自2007年设立第一家异地分行以来,跨区域经营不断推进,先后设立了泰州、北京、上海、杭州、扬州、无锡、南通、苏州、常州、盐城、南京、镇江、宿迁、连云港、江北新区、徐州、淮安17家分行,机构战略布局持续深化。

2014年4月9日,南京银行获得证监会和银监会联合批复的资产管理业务托管业务资格,取得资格后,南京银行充分发挥基金金公司、资产管理等牌照齐全的优势,持续加强与金融同业、投资银行等业务的条线联动,托管产品种类不断丰富,目前可以开展公募基金托管、银行理财托管、基金公司专户产品托管、基金子公司专户/专项产品托管、证券公司定向/集合资产管理计划托管、信托计划托管、私募基金托管、保险资金托管等业务。截至2017年12月31日,南京银行托管产品组合数超过2000只,托管规模超16000亿元。

2.资产托管部组织架构和人员配置情况  
经董事会审议通过,南京银行于2013年10月28日成立了独立的一级部门——资产托管部,下设业务战略部、业务一部、业务二部、内控稽核部、综合管理部,研究开发两个内设部门。

目前,南京银行资产托管部共有54人,其中从事会计核算、资金清算、投资监督、信息披露、内控稽核的人员31人,市场营销17人。相较同期获批基金托管资格的其他银行,南京银行在托管运营上配备较强的人力。

3.托管系统情况  
南京银行托管业务系统建设由深圳市融信信息科技股份有限公司承建,使用了其最新版本的资产托管业务系统,支持目前市场上大多数公募基金公司的托管业务。该系统采用了基于EPC技术、B/S结构、支持远程接入,能够实现与基金管理人、基金注册登记机构、证券登记结算机构等相关业务机构的系统安全对接,具有良好的安全性、稳定性、开放性和可扩展性,且与本行的其他业务系统分离隔离。

我部开发建设了自己的“鑫托管”业务系统。2016年10月,“鑫托管”一期上线,解决了清算系统问题,大大提升了操作效率。2017年5月,系统二期成功上线,实现了业务全流程系统化管理,将系统功能延伸到客户处理端,可通过系统进行指令录入、制款材料上传。

下一阶段,将持续推动系统建设,优化业务流程,提升托管运营效率。一是着力完善“鑫托管”系统功能,使鑫托管系统成为业务平台、数据管理平台、绩效考核平台、内控稽核平台、客户关系平台;二是优化“托管网银”功能,实现与管理人指令系统直连;三是上线银银平台系统,外汇交易中心数据处理系统,进一步优化银行间交易确认和监管流程,满足客户交易时效性要求;四是开发系统级数据统计分析功能,对业务数据进行深入分析利用。

### 三、相关服务机构

(一)国寿安保基金管理有限公司直销中心  
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  
网址:www.sabf.com.cn

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  
网址:https://e.gsfund.com.cn/etrading/

2.其他销售机构  
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:于晓晓

(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:上海市浦东新区银城中路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  
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

执行事务合伙人:毛贲宁  
电话:010-58153000  
传真:010-58188298  
联系人:范新赛  
经办注册会计师:李虹、吴军、范新赛

### 四、基金的名称

国寿安保安享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,包括国债债券、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、地方政府债券、资产支持证券、证券公司短期公司债券、同业存单、债券回购、可分离交易可转债的纯债部分、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),以及法律法规和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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人届时根据相关规定在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。

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%。本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等等。

### 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走势的判断,采用期限匹配下的主动投资策略,主要包含: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、回购套利策略及债券组合投资管理手段,采取积极投资策略,债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测,相机而动,积极调整。  
(一)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,预测未来的利率走势,判断债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、利息免税优势、流动性特点、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优化配置和调整,确定类属资产的最优仓位。

(二)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,而投资者的预期偏好以及各期限的债券供给分布对收益率曲线形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性定量相结合的方法。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,同时结合未来不同的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。

(三)回购套利策略  
本基金将根据中长期的宏观经济变动趋势,形成对未来市场利率变动方向的预期,在一定范围内通过对资金久期进行动态调整,当预期收益率曲线下降时,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。

(四)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做定性判断,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。

(五)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评级给投资组合带来的冲击。

(六)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,或者通过回购的不间断动态套取信用收益和资金成本的成本。

(七)资产支持证券及可转债投资策略  
资产支持证券的投资主要受多种因素影响,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。

(八)证券公司短期公司债券投资策略  
基于控制风险原则,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。

### 九、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、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,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,本基金管理人可以根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前2个工作日内在指定媒介上予以公告,且无需召开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,预期风险收益水平相应高于货币型基金,低于混合型基金、股票型基金,属于证券投资基金中的中低风险收益/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2018年3月31日,报告期间为2018年1月1日至2018年3月31日。本报告财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	2,548,519,000.00	90.42
4	其中:债券	2,282,821,000.00	81.60
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	265,698,000.00	9.43
7	其他投资	-	-
8	其中:国债逆回购	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	3,476,190.00	0.13
10	其他	49,414,186.22	1.75
11	合计	2,818,409,816.22	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。

(1)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

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.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	70,168,000.00	2.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,149,965,000.00	76.31
4	其中:政策性金融债	1,778,950,000.00	63.06
5	企业债	42,820,000.00	1.51
6	中期票据	20,496,000.00	0.72
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,282,821,000.00	81.03

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  
本基金本报告期末未持有股票。

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	140221	14国开21	7,280,000	733,060,000.00	26.05
2	140243	14国开24	2,560,000	252,160,000.00	8.95
3	160422	16农发债22	2,950,000	196,360,000.00	6.94
4	163042	16国开42	1,600,000	158,900,000.00	5.55
5	160909	16国开09	1,200,000	119,380,000.00	4.24

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	179824	17国债12A	1,050,000	105,084,000.00	3.73
2	179846	17国债21A	900,000	90,144,000.00	3.20
3	179848	17国债22A	1,000,000	70,470,000.00	2.50

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五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权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

8.报告期末本基金持有的国债期货投资情况说明  
本基金本报告期末未持有国债期货。

9.投资组合报告附注  
(1)报告期内本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)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	-
2	应收证券利息	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,414,186.22
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	其他	-
9	合计	49,414,186.22

(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、基金的投资

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。

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	①-③	②-④
2018/1/1-2018/3/31	1.75%	0.04%	1.33%	0.04%	0.62%	0.00%
2017/1/1-2017/12/31	1.48%	0.04%	-3.50%	0.06%	4.96%	-0.02%
2016/10/16-2016/12/31	0.68%	0.23%	-2.56%	0.15%	2.64%	0.00%
2016/10/16-2016/3/31	3.35%	0.16%	-2.76%	0.08%	6.13%	0.02%

## 鹏华基金管理有限公司关于增加江苏银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告

根据鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)与江苏银行股份有限公司签署的销售协议,自2018年05月17日起,本公司增加江苏银行股份有限公司为本公司旗下部分基金的销售机构,投资者可通过江苏银行股份有限公司的渠道办理下述基金的开户、交易及基金相关业务。具体基金信息如下:

序号	基金代码	基金名称
1	000907	鹏华新兴产业混合型证券投资基金