

光大保德信安泽债券型证券投资基金

招募说明书摘要（更新）

光大保德信安泽债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年1月4日经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】60号文核准公开募集。本基金份额于2018年7月3日至2018年9月4日发售，本基金合同于2018年9月6日生效。

重要提示

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”、“本基金管理人”或“本公司”）保证本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申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值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。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书

基金产品资料概要、基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，自行承担投资风险。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2020年3月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：光大保德信基金管理有限公司

设立日期：2004年4月22日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42号

注册地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼)，
6-7层、10层

法定代表人：林昌

注册资本：人民币1.6亿元

股权结构：光大证券股份有限公司（以下简称“光大证券”）持55%的股权；
保德信投资管理有限公司持45%的股权

电话：(021) 80262888

传真：(021) 80262468

客服电话：4008-202-888

网址：www.epf.com.cn

联系人：殷瑞峰

（二）主要人员情况

1、董事会成员

林昌先生，董事长，北京大学硕士。历任光大证券南方总部研究部总经理、投资银行一部总经理、南方总部副总经理、投资银行总部总经理、光大证券助理总裁。现任本基金管理人董事长兼总经理（代任）。

Glenwyn P. Baptist 先生，副董事长，美国西北大学管理系硕士学位，CFA。历任保德信金融集团企业金融部助理副总裁、保德信金融集团研究部总监、保德信金融集团业务管理部首席运营官、保德信金融集团市场及业务管理部共同基金总监、保德信金融集团投资管理部首席投资官、保德信金融集团业务管理部总裁兼首席投资官。现任保德信国际投资总裁兼CIO。

俞大伟先生，董事，同济大学工商管理硕士。历任江苏东华期货有限公司苏州办交易部经纪人，上海中期期货经纪有限公司苏州交易部经理，河南鑫福期货

有限公司苏州代表处经理，上海中期期货经纪有限公司苏州营业部副经理、经理，上海中期期货经纪有限公司副总经理，光大期货有限公司常务副总经理、总经理。现任光大期货有限公司董事、总经理。

王俪玲女士，董事，美国波士顿大学硕士，曾任荷兰银行（中国台湾）的法务长，联鼎法律事务所（中国台湾）、泰运法律事务所（中国台湾）律师。现任保德信金融集团高级副总裁兼区域顾问（亚洲）。

孔伟先生，独立董事，甘肃政法学院法律系法学学士学位。曾任职于甘肃省经济律师事务所、史密夫律师行（伦敦、香港）、外立综合法律事务所、上海市瑛明律师事务所。现任北京市中伦（上海）律师事务所上海分所管理合伙人、中微半导体设备（上海）股份有限公司董事、通用环球医疗集团有限公司董事。

郭荣丽女士，独立董事，东北财经大学博士。曾任东北财经大学讲师，招商银行总行会计部副总经理、招商银行南山支行行长、招商银行总行会计部总经理，渤海银行董事、首席财务官，中国银联党委委员、首席财务官兼银联商务股份有限公司董事长。现任上海通华金科投资控股有限公司总裁、通联支付网络服务股份有限公司董事、上海通联金融服务有限公司董事。

王永钦先生，独立董事，复旦大学经济学博士、耶鲁大学博士后、哈佛大学富布赖特高级访问学者。曾任职山东日照纺织抽纱进出口集团公司、山东日照比特集团出口部经理、复旦大学经济学院讲师、副教授。现任复旦大学绿庭新兴金融业态研究中心主任、经济学院 985 平台副主任。

胡雅丽女士，董事，武汉大学硕士。曾任职招商证券股份有限公司家电行业分析师，中信证券股份有限公司家电行业首席分析师、MD、新三板市场首席分析师，光大证券股份有限公司研究所常务副所长。现任光大证券股份有限公司研究所所长。

2、监事会成员

陈浒先生，监事长，华东师范大学工理学士、工学硕士，美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院 MBA。历任陆家嘴（集团）有限公司业务经理，上海市浦东新区金融服务局局长助理，光大证券股份有限公司战略发展部总经理、结构化融资部总经理。现任光大发展投资有限公司总经理。

吴庚辉先生，监事，曼尼托巴大学理学硕士。历任加拿大永明金融集团精算

总监，美国国际集团国际团险管理部副总精算师，美国保德信金融集团集团副总裁兼总精算师、全球资产管理高级投资副总裁、全球审计部高级副总裁。现任美国保德信金融集团全球战略规划董事总经理。

王永万先生，监事，吉林财贸学院经济管理专业学士。曾任海口会计师事务所审计员，海南省国际租赁有限公司证券营业部财务主管，湘财证券有限责任公司海口营业部、深圳营业部及南方总部财务经理，宝盈基金管理有限公司基金会计主管，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司基金运营部总监等职务。现任本基金管理人运营部总监。

赵大年先生，监事，中国科学技术大学统计与金融系学士，中国科学院数学与系统科学研究院统计学专业硕士。历任申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理，钧锋投资咨询有限公司任职投资经理。2009年4月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监（负责量化投资研究等）、量化投资部总监、基金经理、风险管理部副总监，现任风险管理部总监。

3、公司高级管理人员

林昌先生，现任本基金管理人董事长兼总经理（代任），简历同上。

李常青先生，中欧国际工商学院 EMBA。历任中国科学技术大学化学系教师，安徽众城高昕律师事务所律师，天同（万家）基金管理有限公司市场拓展部高级经理、监察稽核部总监助理、北京办事处主任，诺德基金管理有限公司监察稽核部总监等职务，2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任监察稽核部总监、战略发展部总监、督察长兼风险管理部总监，现任本基金管理人副总经理兼子公司执行董事。

盛松先生，北京大学硕士，中国国籍。曾就职于中国科学院空间技术中心科利华有限公司，历任中国光大国际信托投资公司证券部交易部经理，光大证券资产管理总部总经理，2003年参加光大保德信基金管理有限公司筹备工作，2004年4月至2014年8月担任督察长，2018年3月至2019年11月兼任公司量化投资部总监，2017年1月至2020年2月兼任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理。现任本基金管理人副总经理、首席投资总监。

梅雷军先生，吉林大学博士。曾任深圳蛇口安达实业股份有限公司投资管理

部经理，光大证券股份有限公司南方总部机构管理部总经理兼任电脑部总经理、光大证券股份有限公司电子商务一部总经理、信息技术部总经理兼客户服务中心总经理。2004年7月加入光大保德信基金管理有限公司，现任本基金管理人副总经理、首席运营总监兼首席信息官。

董文卓先生，中山大学金融学硕士。历任招商基金管理有限公司实习研究助理、研究员，平安资产管理有限公司固定收益部投资经理，平安养老保险股份有限公司固收投资总监兼固定收益部总经理、年金投资决策委员会委员、年金另类投资决策委员会委员、年金基金经理、专户投资经理、基本养老投资经理等。2017年5月加入光大保德信基金管理有限公司，2017年9月至2019年3月担任专户投资经理。现任本基金管理人副总经理兼固定收益投资总监。

管江女士，上海财经大学财务管理专业学士。历任普华永道（中天）会计师事务所金融组高级审计师。2006年11月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任监察稽核高级经理、监察稽核部副总监。现任本基金管理人督察长、董事会秘书兼监察稽核部总监。

4、本基金基金经理

历任基金经理：

沈荣先生担任本基金基金经理的时间为2018年9月6日至2019年9月18日。

现任基金经理：

周华先生，香港大学金融学硕士。曾任泰康资产管理有限责任公司第三方投资部固定收益投资总监，景顺长城基金管理有限公司投资经理、信用研究员、债券交易员，第一创业证券股份有限公司债券交易员；2018年6月加入光大保德信基金管理有限公司，任职固定收益部投资副总监一职。现任光大保德信晟利债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安诚债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安泽债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

董伟炜先生，硕士。毕业于西南财经大学金融学专业，获得上海财经大学证券投资专业硕士学位。2007年7月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担

任市场部产品经理助理、产品经理，2010年5月后担任投资部研究员、高级研究员。现任光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金基金经理、光大保德信安泽债券型证券投资基金基金经理、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

盛松先生，现任本基金管理人副总经理、首席投资总监。

董文卓先生，现任本基金管理人副总经理兼固定收益投资总监。

戴奇雷先生，现任本基金管理人权益投资部总监兼光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金经理、光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金经理。

林晓凤女士，现任本基金管理人权益投资部副总监兼光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金基金经理、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

上述人员无近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

网址：www.cebbank.com

三、相关服务机构

(一) 直销机构

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢(北区 3 号楼)，
6-7 层、10 层

电话：(021) 80262466、80262481

传真：(021) 80262482

客服电话：4008-202-888

联系人：王颖

网址：www.epf.com.cn

(二) 代销机构

1. 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：王菁

联系人电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

2. 晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦

办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街 1 号丽华大厦

法定代表人：阎俊生

联系人：董嘉文

联系人电话：0351-6819926

传真：0351-6819926

客服热线：95105588

网址：www.jshbank.com

3. 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

客服热线：95511-3

网址：www.pingan.com

4. 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

联系人电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客服热线：95555

网址：www.cmbchina.com

5. 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

法定代表人：陈四清

联系人：郭明

联系人电话：010-66105799

客服热线：95588

网址：www.icbc.com.cn

6. 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系人：朱红

客服热线：95595

网址：www.cebbank.com

7. 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：田国立

客服热线：95533

网址：www.ccb.com

8. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：何耀

联系人电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525

网址：www.ebscn.com

9. 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系人电话：(0351) 8686659

传真：(0351) 8686619

客服热线：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

10. 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

联系人电话：（0755）83073087

传真：（0755）83073104

客服热线：95548

网址：www.cs.ecitic.com

11. 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

客服热线：95357

网址：<http://www.18.cn>

12. 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦21楼

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系人电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服热线：95536

网址：www.guosen.com.cn

13. 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

联系人电话：010-88085858

传真：010-88085195

客服热线：400-800-0562

网址：www.hysec.com

14. 申万宏源证券有限公司

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：陈飙

联系人电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服热线：4008-895-523/021-95523

网址：www.swhysc.com

15. 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系人电话：0755-82960167

传真：0755-83734343

客服热线：4008-888-111/95565

网址：www.newone.com.cn

16. 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

联系人电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

客服热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

17. 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

联系人电话：0531-89606165

客服热线：95548

网址：www.zxwt.com.cn

18. 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 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

联系人电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服热线：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

19. 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

法定代表人：张旭阳

联系人：杨琳

联系人电话：010-61952703

传真：010-61951007

客服热线：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

20. 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 A 座 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

联系人电话：010-56251471

传真：010-62680827

客服热线：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

21. 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团
总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

联系人：李丹

联系人电话：010-89187634

传真：010-89189566

客服热线：95118

网址：kenterui.jd.com

22. 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

联系人：李海燕

联系人电话：010-65309516

传真：010-65330699

客服热线：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

23. 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇 78 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

联系人：张宏鹤

传真：021-53086809

客服热线：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

24. 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周嫵旻

联系人电话：021-60897869、0571-28829790

传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

25. 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

联系人：张蜓

联系人电话：18017373527

客服热线：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

26. 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 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 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

联系人电话：021-58870011

传真：021-68596919

客服热线：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

27. 上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 16 层

法定代表人：陈志英

联系人：韦巍

联系人电话：021-53398816

传真：021-53398801

客服热线：021-53398816

网址：www.luxxfund.com

28. 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

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：021-54509988 分机：7019

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

29. 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：李春光

联系人：徐江

传真：0411-84396536

客服热线：400-0411-011

网址：www.haojiyoujijin.com

30. 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室

法定代表人：李科

联系人：王超

联系人电话：010-59053660

传真：010-8563277

客服热线：95510

网址：fund.sinosig.com

31. 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街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：凌顺平

联系人电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

客服热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

32. 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

联系人：沈晨

联系人电话：010-59336544

传真：010-59336586

客服热线：4008-909-998

网址：<http://www.jnlc.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机构代理销售本基金，并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或减少其销售城市（网点），并另行公告。

（三）登记机构

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层

法定代表人：林昌
电话：(021) 80262888
传真：(021) 80262483
联系人：杨静

（四）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所
注册地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 层
负责人：廖海
电话：021-51150298
传真：021-51150398
联系人：姜亚萍
经办律师：刘佳、姜亚萍

（五）会计师事务所和经办注册会计师

公司全称：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 16 层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
法定代表人：毛鞍宁
电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：蒋燕华、王俊丽
经办会计师：蒋燕华

四、基金的名称： 光大保德信安泽债券型证券投资基金

五、基金的类型： 契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券等）、央行票据、中期票据、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

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%；股票和权证的投资比例不高于基金资产的20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；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，应当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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金根据工业增加值、通货膨胀率等宏观经济指标，结合国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况，综合分析债券市场的变动趋势。最终确定本基金在债券类资产中的投资比率，构建和调整债券投资组合。

2、目标久期策略及凸性策略

在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，即预期利率上升时

适当缩短组合久期，在预期利率下降时适当延长组合久期，从而提高债券投资收益。

由于债券价格与收益率之间往往存在明显的非线性关系，所以通过凸性管理策略为久期策略补充，可以更好地分析债券的利率风险。凸性越大，利率上行引起的价格损失越小，而利率下行带来的价格上升越大；反之亦然。本基金将通过严格的凸性分析，对久期策略做出适当的补充和修正。

3、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强基金的收益。

4、信用债投资策略

信用类债券是本基金的重要投资对象，因此信用策略是本基金债券投资策略的重要部分。由于影响信用债券利差水平的因素包括市场整体的信用利差水平和信用债自身的信用情况变化，因此本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

(1) 市场整体信用利差曲线策略

本基金将从经济周期、市场特征和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。另外，政策因素也会对信用利差造成很大影响。这种政策影响集中在信用债市场的供给方面和需求方面。本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。

本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

(2) 单个信用债信用分析策略

信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。

本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平：

信用债作为发行主体的一种融资行为，发行主体的偿债能力是首先需要考虑的重要因素。本基金将从行业和企业两个层面来衡量发行主体的偿债能力。A) 行业层面：包括行业发展趋势、政策环境和行业运营竞争状况；B) 企业层面：包括盈利指标分析、资产负债表分析和现金流分析等。

抵押物作为信用债发行时的重要组成部分，是债券持有人分析和衡量该债券信用风险的关键因素之一。对于抵押物质量的考察主要集中在抵押物的现金流生成能力和资产增值能力。抵押物产生稳定现金流的能力越强、资产增值的潜力越大，则抵押物的质量越好，从而该信用债的信用水平也越高。

契约条款是指在信用债发行时明确规定的，约束和限制发行人行为的条款内容。具体包含承诺性条款和限制性条款两方面，本基金首先分析信用债券中契约条款的合理性和可实施性，随后对发行人履行条款的情况进行动态跟踪与评估，发行人对契约条款的履行情况越良好，其信用水平也越高。

对于通过发行债券开展融资活动的企业来说，该发行人的公司治理情况是该债券维持高信用等级的重要因素。本基金关注的公司治理情况包括持有人结构、股东权益与员工关系、运行透明度和信息披露、董事会结构和效率等。

5、可转换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择投资价值较高的个券进行投资。

6、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。

7、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

8、证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

基金投资证券公司短期公司债券，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，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

9、债券回购投资策略

在本基金的日常投资中，还将充分利用组合的债券回购操作，利用债券回购收益率低于债券收益率的机会，融入资金购买收益率较高的债券品种，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的债券回购投资策略以放大债券投资收益。

10、国债期货投资策略

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

11、股票投资策略

本基金将采取“自下而上”的方式精选个股。本基金将全面考察上市公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征，同时综合利用市盈率（P/E）、市净率（P/B）和折现现金流（DCF）等估值方法对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备中长期持续增长的上市公司股票库，以获得较高投资回报。

12、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为中债综合财富(总值)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2019年12月31日。

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	98,656,667.40	9.62
	其中：股票	98,656,667.40	9.62
2	固定收益投资	784,884,058.95	76.56
	其中：债券	784,884,058.95	76.56
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	105,514,818.58	10.29
7	其他各项资产	36,171,595.51	3.53
8	合计	1,025,227,140.44	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,668,000.00	0.65
C	制造业	57,612,641.40	6.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,430,000.00	0.97
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,384,000.00	0.85
J	金融业	15,333,910.00	1.76
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	4,228,116.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	98,656,667.40	11.33

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002803	吉宏股份	500,000.00	13,240,000.00	1.52
2	000725	京东方A	2,705,400.00	12,282,516.00	1.41
3	300014	亿纬锂能	210,000.00	10,533,600.00	1.21
4	601668	中国建筑	1,500,000.00	8,430,000.00	0.97
5	600588	用友网络	260,000.00	7,384,000.00	0.85
6	600884	杉杉股份	520,000.00	7,025,200.00	0.81
7	601398	工商银行	1,000,000.00	5,880,000.00	0.68
8	603993	洛阳钼业	1,300,000.00	5,668,000.00	0.65
	601688	华泰证券	270,000.00	5,483,700.00	0.63
	000100	TCL集团	1,000,000.00	4,470,000.00	0.51

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	48,128,860.00	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,213,504.50	0.71
	其中：政策性金融债	6,213,504.50	0.71
4	企业债券	333,471,387.20	38.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	356,587,000.00	40.96
7	可转债（可交换债）	40,483,307.25	4.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	784,884,058.95	90.16

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	143799	18 天目湖	500,000	51,020,000.00	5.86
2	019611	19 国债 01	481,000	48,128,860.00	5.53
3	112854	19 亚迪 01	400,000	40,372,000.00	4.64
4	101681004	16 鹰潭投资 MTN001	450,000	31,504,500.00	3.62
5	101900744	19 漳州经发 MTN001	300,000	30,654,000.00	3.52

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 工商银行（601398）的发行主体于2018年11月23日收到中国保险监督管理委员会北京保监局的行政处罚（京保监罚（2018）28号），具体内容如下：

京保监罚（2018）28号：中国工商银行股份有限公司存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，违反了《中华人民共和国保险法》第一百三十一条的规定

行政处罚决定为：

京保监罚（2018）28号：罚款30万元；

基金管理人按照内部研究工作规范对上述股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。该行政处罚事件发生后，基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

报告期内本基金投资的其他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受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	552,341.56
2	应收证券清算款	11,514,147.56
3	应收股利	-
4	应收利息	13,819,509.78
5	应收申购款	10,285,596.61
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,171,595.51

11.4 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	113020	桐昆转债	5,953,189.50	0.68
2	128046	利尔转债	3,647,113.44	0.42
3	127012	招路转债	2,915,169.60	0.33
4	128061	启明转债	1,893,521.50	0.22
5	128062	亚药转债	1,795,483.96	0.21
6	110054	通威转债	1,793,823.70	0.21
7	110047	山鹰转债	1,729,952.10	0.20
8	110042	航电转债	1,254,263.40	0.14
9	128068	和而转债	761,236.08	0.09
10	113530	大丰转债	498,065.40	0.06
11	113537	文灿转债	108,856.00	0.01
12	123018	溢利转债	106,638.40	0.01
13	123017	寒锐转债	31,361.00	0.00

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

(一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

光大安泽 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
2018年	1.20%	0.10%	1.88%	0.15%	-0.68%	-0.05%
2019年	8.32%	0.16%	7.57%	0.12%	0.75%	0.04%
自基金合同生效日至今	9.62%	0.15%	9.59%	0.13%	0.03%	0.02%

光大安泽 C:

阶段	净值增	净值增长率	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	-----	-------	------	-------	-----	-----

	长率①	标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
2018年	1.07%	0.10%	1.88%	0.15%	-0.81%	-0.05%
2019年	7.85%	0.16%	7.57%	0.12%	0.28%	0.04%
自基金合同生效日至今	9.01%	0.15%	9.59%	0.13%	-0.58%	0.02%

(二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

光大保德信安泽债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年9月6日至2019年12月31日)

1. 光大安泽 A:



2. 光大安泽 C:



注：按基金合同规定，本基金建仓期为2018年9月6日至2019年3月5日。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期内。

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、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、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易或结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的证券、期货账户开户费用、银行间账户维护费用；
- 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。

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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。

3、销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算公式如下：

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

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基

金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。

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。

3、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。

4、基金费用的调整

在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调整基金管理费、基金托管费和销售服务费。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

- 1、本基金的申购费率见下表：

本基金A类基金份额在申购时收取基金前端申购费用；C类基金份额不收取申购费用。

通过直销机构申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
100万元以下	0.08%
100万元（含100万元）到500万元	0.04%
500万元以上（含500万元）	每笔交易1000元

非养老金客户申购本基金A类基金份额申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
100万元以下	0.80%
100万元（含100万元）到500万	0.40%

元	
500 万元以上（含 500 万元）	每笔交易 1000 元

2、本基金 A 类和 C 类基金份额适用相同的赎回费率, 具体费率如下表所示:

持续持有期 (N)	赎回费率
N < 7 日	1.50%
7 日 ≤ N < 30 日	0.10%
N ≥ 30 日	0

3、赎回费用由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, 对持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产; 对持续持有期大于 7 日但少于 30 日的投资人收取的赎回费, 将赎回费总额的 25% 计入基金财产, 其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、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。

5、当发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形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, 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下, 按相关监管部门要求履行必要手续后, 基金管理人可以适当调低基金申购费率和销售服务费率。

十四、对招募说明书更新部分的说明

基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》及其它有关法律法规的要求, 对本基金招募说明书进行了更新, 主要更新内容列示如下:

1. 在“重要提示”中, 更新了招募说明书内容的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”部分, 根据实际情况进行了更新。
3. 在“四、基金托管人”部分, 根据实际情况进行了更新。

4. 在“五、相关服务机构”部分，根据实际情况进行了更新。
5. 在“九、基金的投资”部分，数据更新至12月31日。
6. 在“基金的业绩”部分，数据更新至12月31日。
7. 在“二十二、其他应披露事项”部分，根据实际情况进行了更新。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二〇年四月十七日