

注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

北京路10号 上海市浦东新区世纪大道68号 上海世纪汇广场119层
 邮编：200122 电话：(021) 31358666
 传真：(021) - 31358666
 联系人：李丽娟
 经办律师：王卫、陈国明
 四川中汇基金销售有限公司证券事务所
 机构名称：蒋华东南京中大会计师事务所有限公司
 注册地址：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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
 法人代表：杨皓哲
 电话：(021)-61238888
 传真：(021)-61238800
 联系人：金歆
 经办律师：汪江生、汪彬、金歆

第四部分 基金的名称

契约型开放式 人民币份额 债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型

在满足投资的前提下，本基金为主动管理型股票型基金。

第六部分 基金的投资范围

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、金融债、短期融资券、中央银行票据、企业债、公司债、可转债、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债、资产支持证券等固定收益类品种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。

本基金不能从一级市场购入A股股票，也不参与二级市场新股申购、增发及配股，但可参与二级市场非公开发行股票的认购和申购。

本基金不投资于二级市场当红后市的股票。

纳入投资范围。

本基金投资于债券资产不低于基金资产净值的80%，其中投资于信用评级为AA+（含）AA+之间的信用债的比例不低于非现金基金资产的70%。投资于信用等级为AAA+的信用债资产的比例不超过基金资产的20%。投资于信用等级为AA+的信用债资产不超过基金资产的10%。本基金持有的债券资产，其信用评级须符合中国证监会有关规定。本基金投资于可转债资产，可分散投资于可转债的信用债、资产支持证券等固定收益品种和中央银行票据之外的、具有良好流动性的固定收益品种（不含资产金融债）。次级债、企业债、公司债、中期票据、可交易资产支持证券和资产支持证券的信用评级按照国内机构出具的信用评级以及以下三家国际信用评级机构 Fitch Ratings 信用评级机构出具的信用评级。主要投资于美国市场，主要投资于美国市场 Fitch Ratings 信用评级机构出具的信用评级。主要投资于美国市场，主要投资于美国市场 Fitch Ratings 信用评级机构出具的信用评级。

第八部分 投资策略

本基金通过自上而下和自下而上相结合的投资策略进行补充和调整，确定资产在非长期收益收益证券和非长期收益收益证券之间的配置比例。充分发掘具有投资价值的大中型公司的优质资产，并通过对资产组合的深入分析，深入挖掘具有良好发展前景、具有良好流动性、具有良好流动性的资产，并通过对资产组合的深入分析，深入挖掘具有良好发展前景、具有良好流动性、具有良好流动性的资产。

[illegible]

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的成绩比较基准为：中债企业债总指数收益率 $\times 90\%$ +银行活期存款利率（税后） $\times 10\%$ 。

本基金选择以上复合指数作为业绩比较基准的原因如下：

第一，从指数的客观性和代表性看，中债企业债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制并定期于11月20日对外发布的，中债企业债总指数2002年12月31日对外发布，特别是自2007年1月1日起发布以来，已经形成了基本完备的指数运作体系。中国债券总指数与中国债券市场的发展密切相关，已经形成了基本完备的指数运作体系。

[illegible]

其中：货币资金和结算备付金	228,592,262.41	9.96
其他流动资产	54,124,262.41	2.30
其他非流动资产	2,310,409,436.14	100.00

2. 报告期内投资前五名的股票投资组合

本基金本报告期末无持有股票。

3. 报告期内投资前五名的债券投资组合

本基金本报告期末前十名债券的公允价值如下：

序号	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)	
1	国债逆回购	-	
2	国债逆回购	-	
3	金融债逆回购	79,636,000.00	5.38
4	国债逆回购	79,636,000.00	5.38
5	国债逆回购	1,977,412,172.70	128.83
6	国债逆回购	79,815,000.00	5.43
7	可转债	-	-
8	可转债	-	-
9	可转债	2,027,203,132.70	136.97

5. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五的债券投资组合

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)
1	1208545 12国债18	700,000	71,925,000.00	4.89
2	1202118 11国债18	700,000	69,601,000.00	4.68
3	122534 12国债7	600,000	62,880,000.00	4.23
4	124310 13国债1	600,000	60,502,000.00	4.05
5	1208012 12国债18	500,000	57,507,500.00	3.87

6. 本基金本报告期末持有资产支持证券。

7. 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8. 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9. 报告期内权益类投资

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,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

10. 基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

6) 由于销售费用的摊销、分派之和与合计之间可能存在误差。

第十二部分 基金的费用

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,但不保证基金本金,也不保证最低收益。基金的费用结构由下列费用构成:

1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 基金销售服务费;
4. 基金合同生效前与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5. 基金的证券交易费用;
6. 基金的银行汇划费用;
7. 开户费用;
8. 按照国家有关规定,基金管理人应在基金财产中计提一定比例的销售服务费,并专门用于基金市场推广及销售。

基金合同生效后,基金费用的计提方法及其在基金资产净值中的计提基数由基金管理人确定,并符合基金合同约定。

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2013年1月1日至2013年12月31日	1.40%	0.05%	1.23%	0.04%	0.17%	0.01%
2014年1月1日至2014年6月30日	6.89%	0.11%	3.48%	0.08%	3.41%	0.03%
2014年7月1日至2014年12月31日	9.76%	0.99%	4.76%	0.07%	3.63%	0.02%
2015年1月1日至2015年6月30日	8.39%	0.09%	3.65%	0.07%	3.63%	0.02%

第十三部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

(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. 基金合同生效前与基金相关的信息披露费用;
4. 基金合同生效前与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5. 基金的证券交易费用;
6. 基金的银行汇划费用;
7. 开户费用;
8. 按照国家有关规定,基金管理人应在基金财产中计提一定比例的销售服务费,并专门用于基金市场推广及销售。

[illegible][illegible]