

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要

2017年第1期

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二〇一七年六月

重要提示

大成景穗灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会大成基金于2015年01月26日注册,基金合同于2015年6月4日正式生效。本基金管理人保证本基金的招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金最新招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值或收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书。基金过往业绩并不预示其未来业绩表现。本更新的招募说明书所载内容截止日为2017年5月4日(其中人员变动内容的更新以公告日期为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2017年3月31日,本报告中所有财务数据未经审计。

联系电话:010-66606069
传真:010-68122116
联系人:林薇

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日正式成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点及员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足城市和县域两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托全国领先的分支机构,庞大的电子网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展理财业务的国内商业银行,先后多次荣获金融、银行业权威机构颁发的“全球十佳银行”称号。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(SAE3402)认证,表明了独立第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金理财”TOP100颁奖典礼“最佳托管银行”、“最佳财富管理”、“最佳投资银行”等奖项中名列榜首,荣获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳投资银行”奖。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳托管银行”称号,2013年2016年连续荣获上海证券报授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管银行”称号,2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金融服务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金部于1998年6月经中国证监会和中国人民银行业务批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、证券投资管理部、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理部、技术保障部、营运中心、市场营销部、内控合规部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2.主要人员情况
中国农业银行专业业务部现有员工140名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高,业务素质好,服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高端技术背景,精通国内外证券市场的运作。

3.基金托管业务经营情况
截至2017年3月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共361只。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1.内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法合规、规范运作,严格监控,确保业务的安全稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整,及时、准确地报送相关信息。

2.内部控制组织结构
风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务的全局性风险和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部门下设了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3.内部控制制度及措施
具备完善、严格的内部风险控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位业务、业务操作规范,以及针对业务操作的规范流程和风险控制,业务人员具备从业资格,业务操作实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印控流程保管、存放严格,账户资料严格保管,制约机制严格有效,业务操作区有专人管理,封闭运营,实施物理隔离,业务信息由专职信息管人员负责,防止泄密,业务出现问题及时报告,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金行为的监督方法
基金托管人通过参数设置和(基金法)、《运作办法》、基金合同、托管协议划定的投资比例和投资品种进行实时监控,每日登录证券投资基金监督系统管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金托管人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1.电话提示:对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2.书面警示:对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等情况,以书面形式对基金管理人进行提示;
- 3.书面报告:对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并视情况上报。

三. 相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1.直销机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83196688
联系人:王为开
全国统一客户服务号码:400-888-8568(免长途费)
大成基金管理有限公司在深圳设有投资理财中心:
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦22层
联系人:肖岚、关志岭、刁雪晶
电话:0755-22223529/22223521/22223555
传真:0755-83196235/83196242/83196232

2.代销机构
1.北京农村商业银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门内大街41号
法定代表人:王金山
联系人:董晨
联系电话:010-85606688
传真:010-66506163
客服电话:96198
网址:www.bjrcb.com

2.张家港农村商业银行股份有限公司
注册地址:张家港市杨舍镇人民中路66号
法定代表人:王自忠
客服电话:0612-96065
联系人:施丽娜
电话:0612-56982317
网址:www.zjrcb.com

3.徽商银行股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市庐阳大道258号
法定代表人:吴国辉
联系人:魏芳
客服电话:400888108
电话:010-85130577
传真:010-85182261
网址:www.csb108.com

6.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
法定代表人:陈有安
客服电话:4008-888-888
联系人:宋明
联系电话:010-66568450
传真:010-66588930
网址:www.chinastock.com.cn

7.方正证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街9号新天地的1501
法定代表人:张建军
联系人:王嘉
客服电话:020-38289651
客服电话:400-888-133
网址:www.fzsc.com.cn

8.中泰证券股份有限公司
办公地址:山东省济南市经二路20518号
法定代表人:李玮
联系人:李琦
电话:0531-85123938
传真:0531-81283900
网址:www.ztq.com.cn

9.华福证券有限责任公司
注册地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
联系人:张宏敏
电话:0591-86326
传真:0591-87491150
网址:www.hfzq.com.cn

10.华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:陈敏
联系人:陈敏
客服电话:021-32109999,029-68918888,4001099918
网址:www.cfsc.com.cn

11.爱建证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号13幢2楼
法定代表人:钱伟
客服电话:4001-962-502
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-62878783
网址:www.aqzq.com

12.安信证券股份有限公司
办公地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
法人代表:吴玉明
联系人:刘雯涛
电话:4008363666
电话:02886199765
传真:02886199633

网址: http://www.hx818.com
深圳前海新兰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号
法人代表:杨锦
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
联系人:张蕊
电话:010-58225389-1588
网址:www.new-land.cn
客服电话:400-166-1188

14.诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区 临虹路360号93722室
法定代表人:汪静波
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴908号1楼B12楼
联系人:徐诚
联系电话:021-38609639
网站:www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399

15.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195号30939座
法人代表:其实
联系人:潘世华
电话:021-54609988
传真:021-64387300
客服电话:400-1818-188
网站:www.1234567.com.cn

16.上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号5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
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:张茹
联系电话:021-58870011
传真:021-68686691
网址:www.ehowbuy.com

17.上海晨鑫基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏国际大厦B座16层
法定代表人:张俊伟
客服电话:400-820-2899
网址:www.chenxin.com.cn

18.浙江汇花瑞基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区紫荆和路7号产业创业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8802
传真:0571-88911818-8047
客服电话:4008-773-772
网站地址:www.5ifund.com

19.北京晟视宁投资管理有限公司
注册地址:北京经济技术开发区九渡河路首钢园735号033室
法定代表人:程煜
联系人:李煜
电话:010-58170823
传真:010-58170800
客服电话:400-918-8966
网址: http://fund.sbsghsview.com

20.北京景景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢8层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦(丹棱soho)1108
法定代表人:赵春奇
联系人:魏奇
网站: www.jingjinfund.com
客服电话:400-893-6885

21.上海石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:4000178000
联系人:程佳雯
电话:021-63333219
传真:021-63332519
网址: www.stcfortune.com

22.武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市汉阳区东商务区泛海国际F50HCH(一期)第7栋23层1/1号
法定代表人:陶捷
联系人:杨帆
电话:027-87006003,87006009
网站: www.bji-fund.com
公司网址: 400-888-8568(免长途费)
大成基金管理有限公司在深圳设有投资理财中心:
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦22层
联系人:肖岚、关志岭、刁雪晶
电话:0755-22223529/22223521/22223555
传真:0755-83196235/83196242/83196232

23.上海尚诚资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
联系人:叶倩
电话:0755-89606607
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0600
网址: www.jsastps.com.cn

24.珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号106室-3491
法定代表人:肖雯
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
联系人:黄敏敏
网站: www.yingmi.com

25.奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区燕南路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室
法定代表人:谭广辉
联系人:叶倩
电话:0755-89606607
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0600
网址: www.ifastps.com.cn

26.深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:赖彦军
联系人:张帆
电话:0755-66882931
传真:0755-66882399
客服电话:400-960-0888
网站: www.jfzinv.com

27.北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路2号院1号楼6层2单元2122057
联系人:钟斐斐
电话:010-57273558
客服电话:4000618518
联系人:袁永涛
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址: https://danjuanapp.com

(二)注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:刘卓
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏

四. 基金名称
五. 基金的类型
本基金类型:混合型基金
六. 基金的投资方式
本基金运作方式:契约型、开放式
七. 基金的投资目标
在严格控制风险的前提下,追求基金资产稳定增值。
八. 基金的投资方向
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)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业债、资产支持证券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存单等)、货币市场工具、国债期货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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。
基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于5%;债券、货币市场工具、现金及银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不高于5%;每个交易日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的保证金后,应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规及监管机构的规定执行。

九. 基金的投资策略
本基金将采用“自上而下”的资产配置策略,在综合判断宏观经济基本面、证券市场走势等因素宏观分析的基础上,通过动态调整资产配置比例来控制基金整体风险。在个券投资方面采用“自上而下”精选策略,通过严谨个股选择,分析并拟议对及券种收益水平、流动性的客观判断,综合运用多种投资策略,精选个券构建投资组合。

1. 大类资产配置策略
本基金将密切关注宏观经济、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段所具有的相对投资价值,对各类资产的收益风险特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的状态变化进行及时调整。

2. 债券投资策略
首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、收益率分析等因素确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。

(1)、利率配置策略
本基金将密切关注经济运行趋势,把握领先指标,预测未来走势,深入分析国家推出的财政与货币政策对未来宏观经济运行以及投资环境的影响,据此判断利率趋势和债券市场对上述变化和政策的反应,并据此对债券组合的平均久期进行投资。

(2)、类属配置策略
确定目标久期后,本基金将根据宏观经济、市场利率、债券供求等因素的深入分析,预测各类属资产预期风险及收益情况,确定债券组合资产在利率品种、信用品种等资产之间的分配。

(3)、信用债投资策略
本基金在投资信用债时,本基金投资的每只信用债券需经过公司内部债券信用评级系统进行评级,符合基金所对应的内部评级制度的信用债方可进行投资,以事前防范信用控制使用风险。

(4) 信用利差策略
伴随经济周期的波动,在经济周期的不同阶段,信用利差的变动通常会扩大或缩小,通过对经济周期运行阶段性的判断,把握利差的变动会带来投资机会。同时,本基金将积极关注信用产品发行主体资信水平和信用评级调整带来的投资机会,选择符合有上调可能的信用债,以获取因评级下降带来的价差收益。本基金还将研究各期限信用债的历史信用水平、和相同期限不同信用评级债券的相对利差水平,发掘偏离均值较多、相对利差可能收窄的债券。

(4)、中小企业私募债投资策略
本基金在控制信用风险的基础上,对中小企业私募债投资,将采取分散投资策略,控制个债比例,同时,紧密跟踪还债企业的基本面情况变化,灵活调整投资策略,控制投资风险。

3. 资产支持类证券投资策略
本基金将通过对宏观经济、金融债还本付息、资产池资产以及资产池资产所在行业景气度等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还及变化对标的证券的久期与收益率的影响,在严格控制风险的情况下,结合信用分析和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得超额收益。

4. 股票投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,本基金将适度参与股票、权证等权益类资产的投资,以增强基金收益。
本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法,在拟投资的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法筛选个股。本基金选择的基本面良好、流动性高、低风险、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,选择成长性良好且系统性风险低,追求长期投资价值的长期稳定增值。

投资方式:注重投资性价比与成长潜力的平衡,一方面利用价值投资策略筛选低估值股票,避免市场波动的风险和股票价格高企的风险;另一方面,利用成长性投资策略分享高成长收益的机会。

5. 权证投资策略
权证为基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值,本基金将对权证标的证券的基本面进行分析,综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行投资。

6. 股指期货投资策略
本基金以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性的特点,采取股指期货在短期内取得价差收益,获取市场敞口,投资策略包括多套期保值和空头套期保值。多头套期保值当基金需要买入现货时,为避免市场冲击,提前建立股指期货多头头寸,然后逐步买入现货并解除股指期货多头,当完成现货建仓后将股指期货多头平仓;空头套期保值当基金需要卖出现货时,先建立股指期货空头头寸,然后逐步卖出现货并解除股指期货空头,当现货全部平仓后将股指期货空头平仓。本基金在股指期货投资过程中,将定期跟踪股指期货与股票期货的相关性、投资组合beta的稳定性,精确控制投资组合风险。

7. 国债期货投资策略
国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对国债期货进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现所投资品种的长期稳定增值。

十. 基金的业绩比较基准
三年定期存款税后利率+2%
本基金已在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过大类资产配置,力求实现基金资产的持续稳健增值为投资目标,以“三年定期存款税后利率+2%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。
如果上述基准指数停止计算编制或更名,或者今后法律法规发生变化,或市场出现更适合、更权威的比较基准,并且更适应本基金风格时,经基金托管人同意,本基金管理人可在履行适当程序后,可选用新的比较基准,并将及时公告。上述变更业绩比较基准不需要基金份额持有人大会通过。

十一. 基金的风险收益特征
本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益特征的基金。

十二. 基金投资承诺
基金管理人承诺:本基金投资中不存在虚假记载、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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定,于2017年5月18日复核了本报告期内财务报表,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。
本基金投资组合所披露的大成景穗灵活配置混合型证券投资基金2017年1季度报告,截至2017年3月31日(财务数据未经审计)。

1. 报告期末按资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,286,386.09	8.88
	其中:股票	47,286,386.09	8.88
2	固定收益投资	106,304,091.00	18.92
	其中:债券	106,304,091.00	18.92
	资产支持证券	—	0.00
3	贵金属投资	—	0.00
4	基金投资	—	0.00
5	金融衍生品投资	—	0.00
	其中:买入金融衍生品	396,094,099.99	69.61
	其中:卖出金融衍生品	—	0.00
6	买入返售金融资产	—	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	0.00
7	其他投资	13,712,683.21	2.46
8	其他资产	3,502,278.80	0.63
9	合计	556,605,247.69	100.00

2. 报告期末按行业分类的股权投资组合

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	—	0.00
B	制造业	—	0.00
C	建筑业	37,498,267.07	6.54
D	电力、热力、燃气及生产供应业	—	0.00
E	批发零售业	26,039.52	0.00
F	金融业	1,341,000.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	3,900,000.00	0.69
H	住宿和餐饮业	—	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,393,500.00	0.25
J	金融业	—	0.00
K	房地产业	6,474,000.00	1.13
L	科学研究和技术服务业	—	0.00
M	科学研究和技术服务业	—	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	—	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	0.00
P	教育	—	0.00
Q	卫生和社会工作	—	0.00
R	文化、体育和娱乐业	—	0.00
S	综合	47,206,386.09	8.63

3. 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

无。

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股票投资

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	600436	片仔癀	180,000	9,062,200.00	1.60
2	600066	亨通光电	300,000	6,215,000.00	1.10
3	000838	兰石重装	70,000	9,669,400.00	1.70
4	002776	XX股份	300,000	2,426,000.00	0.43
5	000048	保利地产	300,000	2,859,000.00	0.52
6	000425	华发股份	400,000	2,624,000.00	0.48
7	000618	陇神药业	50,000	2,150,000.00	0.39
8	000618	陇神药业	50,000	1,886,000.00	0.34
9	000689	张裕A	50,000	1,844,000.00	0.34
10	002223	启辰股份	50,000	1,694,000.00	0.30

5. 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	4,066,560.00	0.74
2	央行票据	—	0.00
3	金融债券	30,009,000.00	5.40
	其中:政策性金融债	30,009,000.00	5.40
4	企业债券	69,720,000.00	12.50
5	企业短期融资券	9,963,000.00	1.80
6	中期票据	—	0.00
7	可转债(可交换)	526,532.40	0.10
8	国债期货	—	0.00
9	其他	—	0.00
10	合计	106,304,091.00	19.26

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债券投资

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	140208	14附债08	300,000	30,000,000.00	5.40
2	1402123	14附债123	300,000	21,720,000.00	3.97
3	120205	12附债05	200,000	12,476,000.00	2.27</