

中欧基金管理有限公司中欧兴利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第2号)

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
二〇一七年十一月

本基金经2016年7月24日中国证监会监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予中欧兴利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1787号文）准予募集注册。本基金基金合同于2016年9月25日正式生效。

重要提示

基金管理人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备案，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债券存在因市场交易不足而不能迅速、低成本地转变为现金的流动性风险，以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险，可能影响基金资产变现能力，造成基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则，审慎参与中小企业私募债券的投资，严格控制中小企业私募债券的投资风险。

本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于混合型、股票型基金，属于较低预期风险/收益的产品。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金销售人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人因投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，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。

本更新招募说明书摘要所载内容截止日为2017年9月24日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

1. 名称：中欧基金管理有限公司
2. 住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层
3. 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层、上海市虹口区公平路18号8栋-嘉显大厦7层
4. 法定代表人：裘玉明
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2006年7月19日
7. 批准设立机关：中国证监会
8. 批准设立文号：证监基金字[2006]102号
9. 存续期间：持续经营
10. 电话：021-68609600
11. 传真：021-33830351
12. 联系人：袁维
13. 客户服务热线：021-68609700, 400-700-9700（免长途话费）
14. 注册资本：1.88亿元人民币
15. 股权结构：

序号	股东名称	出资额（万元）	出资比例
1	意大利意联银行股份有限公司	4700	25%
2	国都证券股份有限公司	3760	20%
3	北京百骏投资有限公司	3760	20%
4	万融基金投资有限责任公司	620.4	3.30%
5	上海锦忆投资管理合伙企业（有限合伙）	3760	20%
6	裘玉明	940	5%
7	周玉雄	280.50	1.4826%
8	卢纯青	140	0.7447%
9	于浩	140	0.7447%
10	赵国英	140	0.7447%
11	方甲	100	0.5319%
12	天子阳	100	0.5319%
13	于耀忠	79.01	0.4203%
14	魏博	75	0.3989%
15	郑芳彤	75	0.3989%
16	俞廷	75	0.3989%
17	魏志超	65	0.3503%
	合计	18,800	100%

二、主要人员情况

1. 基金管理人董事会成员
裘玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学MBA，中国国籍。中欧基金管理有限公司董事长、上海盛立基金会理事兼理事，国寿投资控股有限公司独立董事，天合光能有限公司董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

Marco D' Este 先生，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份有限公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在Creditoitaliano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鼎卿先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司、国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理、投行业务董事及内核小组副组长。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副教授，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson先生，英国籍。现任IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会—资深会员及香港注册会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰、伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南卡罗来纳大学法学博士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学MBA学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

2. 基金管理人监事会成员

廖步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长、中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券股份有限公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深宏工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所律师合伙人，美国纽约州Schulte Roth & Zabel LLP律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所律师上海分所合伙人。

陆正芳女士，监事，现任中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，监事，现任中欧基金管理有限公司客户服务总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士。历任大通证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

3. 基金管理人高级管理人员

裘玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。
刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

顾伟先生，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，中国籍。上海财经大学金融学硕士，16年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理中心债券部研究员、研究主管，平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，12年以上基金从业经验。历任北京华夏华联会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，16年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部副总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

于亚女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，10年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

4. 本基金基金经理

（1）现任基金经理

姓名	朱禹杰	性别	男
国籍	中国	毕业院校及专业	法国北方高等商业学校金融学专业
其他公司任职	法国兴业银行投资银行部交易助理，海通证券股份有限公司债券基金部销售交易员，平安证券有限责任公司固定收益事业部交易员		
本公司历任	中欧基金管理有限公司投资经理		
本公司现任	基金经理		
基本任职情况	产品名称	起止日期	离任日期
1	中欧颐康稳健债券型证券投资基金	2017年04月07日	
2	中欧瑞博灵活配置混合型证券投资基金（LOF）	2017年04月07日	
3	中欧弘利债券型证券投资基金（LOF）	2017年04月07日	
4	中欧瑞福混合型证券投资基金（LOF）	2017年04月07日	
5	中欧兴利债券型证券投资基金	2017年04月07日	
6	中欧瑞恒混合型证券投资基金	2017年06月02日	
7	中欧瑞多策略定期开放债券型证券投资基金	2017年04月07日	
8	中欧瑞通灵活配置混合型证券投资基金	2017年04月07日	
9	中欧瑞锦定期开放债券型证券投资基金	2017年04月07日	
10	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2017年04月07日	
11	中欧瑞泽债券型证券投资基金	2017年04月07日	
12	中欧瑞新债券型证券投资基金	2017年04月07日	
13	中欧瑞利债券型证券投资基金	2017年04月07日	
14	中欧瑞盛灵活配置混合型证券投资基金	2017年04月07日	

（2）历任基金经理

基金经理	起止日期	离任日期
刘伟	2016年09月25日	2017年06月27日

5. 基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、副总经理顾伟、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、周玉雄、曲伟、赵国英、曹名长、王健、王蔚、吴鹏、马蔚华组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主任。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

（一）基金托管人情况
1. 基本情况
名称：兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路154号
办公地址：福州市湖东路154号
法定代表人：高建平
注册日期：1988年8月22日
注册资本：人民币207.74亿元
托管部门联系人：刘峰
电话：021-62577777-212017
传真：021-62159217

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本190.52亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2016年末，兴业银行总资产达6.09万亿元，实现营业收入1570.6亿元，实现净利润538.5亿元。

在2016年英国《银行家》杂志全球银行1000强排名中，兴业银行按总资产排名第33位，按一级资本排名第32位；在2016年《财富》世界500强中，兴业银行排名第195位；在2016年《福布斯》全球上市企业2000强排名中，兴业银行位居第59位，稳居全球银行500强、全球上市企业100强、世界企业500强。品牌价值持续提升，根据英国《银行家》杂志联合世界知名品牌评估机构Brand Finance发布的“2017全球银行品牌500强”榜单，兴业银行排名第21位，大幅上升15位，品牌价值突破百亿美元达105.67亿美元，同比增长63.70%。在国内外权威机构组织的评比中，兴业银行连续六年蝉联中国银行业“年度最具社会责任金融机构奖”，并先后获得“亚洲卓越商业银行”、“杰出银行奖”、“年度最佳股份制银行”、“卓越竞争力金融控股集团”、“卓越创新银行奖”、“年度优秀绿色金融机构”、“最佳责任企业”等多项殊荣。

2. 主要人员情况
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

3. 基金托管业务经营情况
兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截止2017年6月30日，兴业银行已托管开放式基金183只，托管基金资产规模6741.64亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

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，守法经营、规范运作，严格监察，确保业务稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2. 内部控制组织结构
兴业银行基金托管业务内部控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行设资产托管部，法律与合规部、法律与合规部业务风险控制工作由指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3. 内部控制控制原则
（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上更形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和可操作性。

（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

（6）有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具

有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

（7）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

（8）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及负有领导责任的主管领导进行问责。

4. 内部控制制度及措施
（1）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（2）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（3）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（4）相对独立的业务操作空间：业务操作区域相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（5）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（6）应急预案：制定完善的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
基金托管人负有对基金管理人的投资运作行为进行监督稽核的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人存在违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构
1. 直销机构
名称：中欧基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉显大厦7层
法定代表人：裘玉明
联系人：袁维
电话：021-68609602
传真：021-68609601
客服热线：021-68609700, 400-700-9700（免长途话费）
网址：www.zofund.com

2. 其他销售机构
名称：国都证券股份有限公司
住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：王少华

联系人：黄静
电话：010-84183389
传真：010-64482090
客服热线：400-818-8118
网址：www.guodu.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

二、登记机构
名称：中欧基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋-嘉显大厦7层
法定代表人：裘玉明
总经理：刘建平
成立日期：2006年7月19日
电话：021-68609600
传真：021-68609601
联系人：杨敏

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：上海市银城中路68号时代金融中心29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
经办律师：黎明、陆奇
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陆奇

四、审计、基金资产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展翼银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
电话：021-23238189
联系人：俞伟敏
经办注册会计师：许康伟、俞伟敏

第四部分 基金的名称
中欧兴利债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型
契约型 开放式

第六部分 基金的投资目标
在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等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）。

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。

基金的投资组合比例为：
（1）全面性原则：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

第八部分 基金的投资策略
（一）固定收益投资策略
本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

（1）久期偏离
本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性和定量分析，预测利率和定价趋势，从而采取久期调整策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。

（2）期限结构配置
本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

（3）类属配置
类属配置指债券组合中各债券品种间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转债债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

（4）个券选择
个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。

（二）资产支持证券投资策略
本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎进行资产支持证券投资。

（三）中小企业私募债投资策略
与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价；③综合上述分析结果，确定信用风险的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

第九部分 基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率
中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征
本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

基金管理人根据基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自本基金2017年第2季度报告，所载数据截至2017年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
2	其中：股票	--	--
3	基金投资	--	--
3.1	固定收益投资	4,810,533,746.00	96.77
3.2	其中：债券	4,760,533,746.00	95.77
3.3	资产支持证券	50,000,000.00	1.01
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	56,770,388.29	1.14
6.1	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	4,671,888.77	0.09
8	其他资产	96,530,040.02	1.99
9	合计	4,970,306,003.08	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
2.2 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股票。

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	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	736,913,000.00	14.83
3.1	其中：政策性金融债	669,111,000.00	13.47
4	企业债券	2,106,210,246.00	44.00
5	企业短期融资券	1,168,820,500.00	23.32
6	中期票据	514,732,000.00	10.36
7	可转债(可交换债)	--	--
8	回购存单	163,858,000.00	3.30
9	其他	--	--
10	合计	4,760,533,746.00	