

# 中欧基金管理有限公司 中欧强裕债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第七号)

基金管理人:中欧基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
二〇一七年十二月

本基金经2016年07月01日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予中欧强裕债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1468号文)准予募集注册。本基金合同于2016年11月7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注册,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,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。

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管理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、大量赎回或赎回导致的流动性风险、基金管理人在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对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11月6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9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

- 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7层
- 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-楼-嘉昱大厦7层
- 法定代表人:窦玉明
- 组织形式:有限责任公司
- 设立日期:2006年7月19日
- 批准设立机关:中国证监会
- 批准设立文号:证监基金字[2006]102号
- 存续期间:持续经营
- 电话:021-68609600
- 传真:021-33830351
- 联系人:袁维
- 客户服务热线:021-68609700,400-700-9700(免长途话费)
- 注册资本:1.88亿元人民币
- 股权结构:

序号	股东名称	出资额(万元)	出资比例
1	意大利联合银行股份有限公司	4700	26%
2	国联证券股份有限公司	2760	26%
3	北京广安投资有限公司	2760	26%
4	万盛基金投资有限公司	620.4	3.30%
5	上海瀚亿投资管理有限公司(有限合伙)	2760	26%
6	第三只眼	1940	1.1%
7	卢煜盛	209.69	1.1625%
8	卢煜盛	140	0.7447%
9	于浩	140	0.7447%
10	赵超豪	140	0.7447%
11	方羿	100	0.5319%
12	关子阳	100	0.5319%
13	王敏云	75.01	0.4303%
14	魏博	75	0.3989%
15	郝丹丹	75	0.3989%
16	郝斌	75	0.3989%
17	黎晓海	55	0.2928%
	合计	18,390	100%

### 二、主要人员情况

#### 1. 基金管理人董事会成员

窦玉明先生,清华大学经济管理学院本科、硕士,美国杜兰大学MBA,中国籍。中欧基金管理有限公司董事长,上海盛立基金企业管理理事,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。历任布雷斯西农业信贷银行(CAB)国际部总监,联合信贷银行(Unicredit)米兰总部客户服务部客户关系管理、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,意大利联合银行股份有限公司(UBI)机构银行业务部总监,并曾在CreditoItaliano(意大利信贷银行)任首席执行官、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱劭群先生,中国籍。现任中欧基金管理有限公司、国都瑞盈投资有限公司副总经理。曾任联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,中国证监会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)及英国毕马威(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,中国籍。现任北京大学法学院教授、博士生导师,中欧基金管理有限公司独立董事。法学博士,应用经济学博士后,德国洪堡学者,中国银行法学研究会副会长。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等,毕业于北京大学、美国南美以美大学、哈佛大学法学院。

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。

#### 3. 基金管理人监事会成员

唐步先生,中欧基金管理有限公司监事会主席,中欧盛资产管理(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。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问,广东钧天律师事务所合伙人,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理财规划总监,中国籍,同济大学法学院应用专业学士。历任大连证券上海普路营业部系统管理员,大通证券上海普路营业部客户服务部主管。

#### 3. 基金管理人高级管理人员

窦玉明先生,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。历任平安集团固定收益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理,兼任中欧基金管理有限公司研究总监、策略组负责人,中国籍。加拿大圣母玛利亚金融学硕士,12年以上基金从业经验。历任北京毕马威振华会计师事务所审计,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部总经理,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总监,富国基金管理有限公司总经理助理。

王玺云女士,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	尹耀耀	性别	男
国籍	中国	毕业院校及专业	美国莱斯大学统计学专业
其他公司历任	招商证券股份有限公司固定收益总部研究员、投资经理		
本公司历任	中欧基金管理有限公司基金经理兼研究员		
本基金投资管理基金具体情况	产品名称	起始日期	离任日期
1	中欧强裕债券型证券投资基金	2017年08月20日	
2	中欧弘发一年定期开放混合型证券投资基金	2017年03月03日	
3	中欧弘发一年定期开放混合型证券投资基金	2017年07月04日	
4	中欧睿诚定期开放混合证券投资基金(LOP)	2016年12月01日	
5	中欧强盛债券型证券投资基金	2016年11月08日	
6	中欧天禧纯债债券型证券投资基金	2015年12月31日	
7	中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金	2015年03月23日	
8	中欧瑞丰纯债债券型证券投资基金	2015年06月26日	2016年06月17日
9	中欧瑞丰纯债债券型证券投资基金	2015年06月26日	

姓名	朱赓杰	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专业
其他公司历任	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融资部销售交易员,平安证券有限责任公司固定收益部交易员		
本公司历任	中欧基金管理有限公司投资经理		
本基金投资管理基金具体情况	产品名称	起始日期	离任日期
1	中欧瑞盛灵活配置混合型证券投资基金	2017年04月07日	
2	中欧弘利债券型证券投资基金	2017年04月07日	
3	中欧瑞裕纯债证券投资基金(LOP)	2017年04月07日	
4	中欧瑞丰纯债证券投资基金	2017年04月07日	
5	中欧瑞丰多策略定期开放债券型证券投资基金	2017年04月07日	
6	中欧瑞盛定期开放混合型证券投资基金	2017年04月07日	
7	中欧瑞盛灵活配置混合型证券投资基金(LOP)	2017年04月07日	
8	中欧瑞丰多策略定期开放债券型证券投资基金	2017年04月07日	
9	中欧聚源货币市场基金	2017年06月03日	
10	中欧弘利债券型证券投资基金	2017年04月07日	
11	中欧瑞裕纯债证券投资基金(LOP)	2017年04月07日	
12	中欧弘信增利债券型证券投资基金(LOP)	2017年04月07日	
13	中欧瑞盛灵活配置型证券投资基金(LOP)	2017年04月07日	
14	中欧瑞裕纯债证券投资基金	2017年04月07日	

##### (2) 历任基金经理

基金经理	起始日期	离任日期
刘建平	2016年11月5日	2017年06月22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高级投资决策机构,由总经理刘建平、副总经理顾伟、副总经理兼策略组负责人卢纯青、信用评估负责人张明、策略组负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、黄华、周玉雄、赵国英、曲经、曹名长、王健、王碧、吴鹏飞组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

##### 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:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万肆仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人:陈四清
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942

中国银行股份有限公司客服电话:95566

##### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称,为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QDII、ROFII、ODI、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

##### (三) 证券投资基金托管情况

截至2017年09月30日,中国银行已托管637只证券投资基金,其中境内基金600只,QDII基金37只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

##### (四) 托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的重要组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险管理工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制 制 度 审 计 工 作。先后获得基于“SAS70”、“AAPO1/06”“ISAE3402”和“ISAE316”等国际主流内部控制审计准则的无保留意见的审计报告。2017年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SASB16”双准则的内部控制审计报告,中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人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,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

##### 第三部分 相关服务机构

##### 一、基金份额发售机构

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-楼-嘉昱大厦7层
法定代表人:窦玉明
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)
网站:www.zofund.com
各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。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
法定代表人:窦玉明
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:杨毅

##### 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
经办律师:黎明、陆奇
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陆奇
四、审计基金财产的会计师事务所
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号星展银行大厦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:俞卫敏
经办注册会计师:许康玮、俞伟敏

第四部分	基金名称
中欧强裕债券型证券投资基金	
第五部分	基金的类型
契约型 开放式	

在严格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。

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、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金后,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

本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合投资。根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预测未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置,在确定组合久期基础上进行利率期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析,“自上而下”在各类债券资产类别之间进行类属配置,“自下而上”进行个券选择。在目标收益率以及个券收益率变化过程中,灵活运用骑乘策略、套息策略、利差策略等增强组合收益。当市场收益率上行时,基金管理人将运用国债期货对组合中的债券资产进行套期保值,以回避一定的市场风险。

##### 1、利率预期策略

(1)久期策略
久期策略是指,根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估,并考虑在运作周期中所处阶段,确定债券组合的久期配置。本基金将在预期市场利率下行时,适当拉长债券组合的久期水平,在预期市场利率上行时,适当缩短债券组合的久期水平,以此提高债券组合的收益水平。

(2)收益率曲线策略
收益率曲线策略是指,首先评估均衡收益率水平,以及均衡收益率曲线合理形态,然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,评估不同剩余期限下的价值偏离程度,在满足既定的组合久期要求下,根据风险调整后的预期收益率大小进行配置,由此形成子弹型、哑铃型或者阶梯型的期限配置策略。

##### 2、信用策略

(1)类属配置策略
类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上,通过情景分析和历史预测相结合的方式,“自上而下”在债券一级市场和二级市场,银行间市场和交易所市场,银行存单、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置,进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

##### (2)个券选择策略

基金管理人自建财务研究资料库,并对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析,比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、赎回因素等,进行个券选择。

##### 3、时机策略

(1)骑乘策略
当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

(2)息差策略
利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

##### (3)利差策略

对两个期限相近的债券的利差进行分析,从而对利差水平的未来走势做出判断,从而进行相应的债券置换。当预期利率水平小时,可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当预期利率水平扩大时,可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。

4、资产支持证券投资策略
本基金通过对手资产支持证券资产池结构和质量的跟踪测评、分析资产支持证券的发行条款、资产提前偿付率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

5、国债期货投资策略
本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以争取相应债券组合的超额收益。

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,而无须召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日内指定公告予以披露。

##### 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。

第十一部分 基金的投资组合报告
一、基金管理人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。

基金托管人根据基金合同规定,复核了本报告投资组合报告,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3季度报告,所载数据截至2017年9月30日,本报告中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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	--	--
其中:股票	--	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	52,411,875.00	81.81
其中:国债	52,411,875.00	81.81	
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	10,000,135.00	15.61
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	638,882.28	0.99
8	其他资产	1,020,426.97	1.60
9	合计	64,069,113.25	100.00

- 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。
- 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股票。
- 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

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	240,475,000	0.40
2	央行票据	--	--
3	金融债	2,994,000.00	4.83
其中:政策性金融债	2,994,000.00	4.83	
4	企业债	40,188,300.00	79.32
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转换债券(含交换债)	--	--
8	资产支持证券	--	--
9	其他	--	--
10	合计	52,411,875.00	84.56

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劵投资明细			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	130605	14国债02	40,000
2	130519	16国债01	40,000
3	130527	16国债03	40,000
4	112052	11国债06	35,000
5	122330	13中债06	30,000

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十名资产支持证券投资明细			
序号	证券代码	证券名称	数量(张)
1	130605	14国债02	40,000
2	130519	16国债01	40,000
3	130527	16国债03	40,000
4	112052	11国债06	35,000
5	122330	13中债06	30,000

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