

# 中银量化价值混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第2号)

基金管理人：中银基金管理有限公司  
基金托管人：兴业银行股份有限公司

重要提示  
本基金经2017年6月16日中国证券监督管理委员会证监许可[2017] 941号文募集注册。

本基金的基金合同于2017年11月24日正式生效。  
基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书根据中国证监会注册，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做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。  
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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件，基金份额持有人依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和与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，并构成《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。基金管理人承诺为基金份额持有人提供公平、合理、适当的服务。应详细了解基金合同、基金招募说明书。  
投资者有风险，投资者根据持有基金份额享基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书基金合同等所有信息披露文件，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，自主做出投资决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而产生的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金实施过程中存在基金管理人、基金托管人的操作风险，基金投资过程中产生的操作风险。因违反合同约定和投资指令引发的信用风险，基金投资于股票与投资策略引致の特有风险，等等。本基金投资中小企业私募债券、中小企业私募债是依据相关法律法规并在上市公司企业采用非公开方式发行的债券。由于非公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发生主体信用资质恶化时，受市场流动性影响，本基金可能无法及时出售所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金的特定风险包括：  
1、基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。  
2、投资者应充分考虑到本产品的风险承受能力，并对于认购(或申购)基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策。  
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也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。  
基金管理人—投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总额的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。  
本招募说明书所载内容截止至2019年5月23日，基金投资组合报告和基金业绩表现等相关财务数据截止至2019年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人兴业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

客户联系人：李建红  
客服电话：96566  
联系人：邓朝刚

网站：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)  
基金管理人：中银基金管理有限公司  
注册地址：福州市湖东路154号中大厦  
办公地址：福州市湖东路154号中大厦  
法定代表人：高建平  
客户服务电话：96561

联系人：李博  
网站：[www.eib.com.cn](http://www.eib.com.cn)

基金管理人：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2层  
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  
客服电话：96021/4001818188

基金管理人：东方财富证券股份有限公司  
注册地址：上海市虹口区四川北路3408号4楼  
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
法定代表人：汪立光  
客服电话：4008219031

基金管理人：诺亚基金销售有限公司  
注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢6层609室  
办公地址：浙江省杭州市西湖区转塘18号黄龙时代广场B座6F  
法定代表人：胡继忠  
客服电话：4000-766-123

基金管理人：汇成基金销售有限公司  
注册地址：上海市浦东新区成山路1476号2楼  
办公地址：上海市浦东新区成山路1476号2楼  
法定代表人：王伟刚  
客服电话：4008771088

基金管理人：上海天天基金销售有限公司  
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
法定代表人：汪立光  
客服电话：4008219031

基金管理人：好买基金销售有限公司  
注册地址：上海市虹口区东长治路196号2号楼2楼411号  
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路1118号锦都大厦903-906室  
法定代表人：杨文斌  
客服电话：4007009665

基金管理人：上海爱建基金销售有限公司  
注册地址：上海市虹口区四川北路3408号4楼  
办公地址：上海市虹口区四川北路3408号4楼  
法定代表人：李梦琦  
客服电话：020-89629066

基金管理人：上海利得基金销售有限公司  
注册地址：上海市浦东新区城南路200号中银大厦45楼  
办公地址：上海市浦东新区城南路200号中银大厦26楼、27楼、45楼  
法定代表人：李秀喜  
客服电话：021-38834999

基金管理人：高毅秋  
注册资本：1亿元人民币  
股权结构：  
中国银行股份有限公司 82.5%  
贝莱德投资管理(美国)有限公司 16.5%

(二) 主要人员情况  
1、董事  
李道刚 (ZHANG Yan) 女士，董事长，国籍：中国，英国伦敦大学政治经济学院公共金融政策专业硕士。现任中银基金管理有限公司董事长。历任中国银行总行资产管理部主管、助理总经理、副总，总行金融市场部、投资银行与资产管理部总经理。

李道明 (Li Daoming) 先生，董事，国籍：中国。清华大学生物医学博士。中银基金管理有限公司执行董事。2000年10月至2012年4月任联华资本基金管理有限责任公司，历任市场部副总监、总裁、助理和风险控制部副经理。

魏新 (HAN Wen) 先生，董事，国籍：中国。首都经济贸易大学经济学学士。现任中国银行总行人力资源副经理。历任中国建设银行北京市分行公司业务部高级经理，通州支行副行长，海淀支行副行长，土地支行副行长(主持工作)、行长、丰台支行行长等职。

王卫东 (Wang Weidong) 先生，董事，国籍：中国。清华大学-香港中文大学MBA，北京大学学士。现任中国银行总行投资银行与资产管理部副经理。历任中国银行总行资金部交易员，中国银行香港分行投资经理，中国银行金融市场总部高级交易员、主管，中国银证大资产管理部副经理、主管，中国银行上海分行金融市场部总经理等职。

曾仲敏 (Paul Tsang) 先生，董事，国籍：中国。为贝莱德亚太区首席风险管理总监、董事总经理，负责领导亚太区的风险管理工作，同时担任贝莱德亚太区执行委员会成员。曾先生于2015年6月加入贝莱德。此前，他曾担任摩根士丹利亚洲首席风险管理总监，以及亚太区执行委员会成员，带领高阶的风险管理国际、资产管理摩根士丹利在亚洲各经营范围的市场、信贷及营运风险，包括机构销售及交易、股票及固定收益、资本市场、投资银行、投资组合及风险管理业务。曾先生毕业于普林斯顿大学风险管理专业，效力九年，并曾于摩根的衍生衍生工具交易风险结构工作两年。曾先生现任中国清华大学及北京大学风险资产管理客座讲师。他拥有美国威斯康星大学麦迪逊分校工商管理学士学位，以及宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士学位。

赵成树 (ZHAO Xingde) 先生，独立董事。国籍：中国。美国西北大学经济学博士。曾在英国威廉与玛丽学院商学院任教，并曾为美国投资公司协会(美国共同基金行业行业协会)首席执行官。现任中欧国际工商学院金融学与社会会计学教授、副教授及金融MBA主任，并在华信证券担任独立董事。

杜惠芳 (DU Huifang) 女士，独立董事。国籍：中国。山西财经大学经济学学士，美国俄克拉荷马州梅森商学院工商管理硕士，澳大利亚国立大学高级访问学者，中央财经大学博士。现任中央财经大学金融学院教授，兼任新时代信托股份有限公司独立董事。曾任山西财经大学会计学院讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学会计学院教授、副院长，中央财经大学金融学院副院长等职。

陈一舟 (Pu Lei) 先生，独立董事。国籍：中国。首都经济贸易大学管理学博士。现任首都经济贸易大学会计学院教授、博士生导师，兼任中国财务会计学会常务理事、中国内部审计协会理事，中国会计学会会计专业委员会主任、北京会计学会常务理事、北京总会会计师学术委员，江河创建集团股份有限公司独立董事、北京九强生物技术股份有限公司独立董事、航天长峰化学工程股份有限公司独立董事、国投泰康信托有限公司独立董事、中监证协监事。

卢广华 (LU Jinqiang) 先生，监事，国籍：中国。南京政法学院法学硕士，历任空军指挥学院教授、中国银行总行机关党委组织部副部长、武汉中北支行副行长、企业年金理事会高级经理、投资银行与资产管理部高级交易员。

赵博偉 (ZHAO Boqing) 女士，职工监事，国籍：中国，研究生学历。历任辽宁省证券公司上海总部交易员、天治基金管理有限公司交易员、中银基金管理有限公司交易员、交易主管。现任中银基金管理有限公司交易部总经理。

李道贤 (Li Daobian) 先生，董事，执行董事兼基金经理。  
欧阳向军 (Jason X. OUYANG) 先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会—沃顿商学院高级管理培训(Wharton-SAC Executive Program)毕业证书，加拿大西密尔大学彼得商学院 (vey加拿大大学 Business, Western University) 工商管理硕士 (MBA) 和经济学硕士。曾任加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人养老保险公司等海外机构从事风险管理十多年，也曾担任新南威尔士大学(澳大利亚)“研究发展中心”中心总经理、金融管理学院市场风险管理总监、温斯顿威尔士大学(英国)大学国际金融系国际金融教授兼任主任。

张克文 (ZHANG Jiawen) 先生，副执行总裁。国籍：中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行、苏州分行副行长、党委书记、副行长。

陈军 (CHEN Jun) 先生，副执行总裁。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学香槟分校 MBA。2004年加入中银基金管理有限公司，历任基金销售、权益管理部总经理，助理执行总裁。

王黎明 (WANG Shengming) 先生，副执行总裁。国籍：中国。北京师范大学教育管理学院硕士。现任中银基金管理有限公司副执行总裁。历任中国银行托管业务部总经理。

4、基金经理  
赵志华 (ZHAO Zhihua) 先生，中银基金管理有限公司助理副经理(AVP)，金融工程博士。曾任华夏银行基金管理部投资主管，资产管理部总经理。2011年7月至2018年2月中银优秀企业基金经理，2016年6月至2018年2月任中银量化价值基金经理，2016年11月至今任中银研究精选基金经理，2018年12月至今任中银量化价值基金经理，2017年11月至今任中银量化价值基金经理。具有13年证券从业年限，具备基金从业资格。

王蔚 (Wang Weijie) 执行总裁  
张发荣 (张发荣) 执行总裁  
袁鹏洲 (固定收益投资部总经理)、李健 (权益投资部总经理)、张发荣 (研究部总经理)、方明 (专户理财部副总经理)、李海洋 (财富管理部副总经理)

列席高管：段晓刚(董事长)、曹长林(监事长)  
6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人  
(一) 基金托管人  
名称：兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)  
注册地址：福州市湖东路154号  
办公地址：上海市江宁路168号  
法定代表人：高建平  
成立时间：1988年8月22日  
注册资本：207.74亿元人民币  
存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号  
托管部联系人：吴王蓉  
电话：021-52629999  
传真：021-62611927

(二) 发展概况及财务状况  
本行成立于1988年，是全国首批股份制商业银行之一，总行设福建省福州市，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207.74亿元。

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2018年12月31日，兴业银行资产总额达261.71万亿元，实现营业收入182.87亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润60.20亿元。根据2017年英国《银行家》杂志“全球银行1000强”排名，兴业银行位列全球排名第28位，按总资产排名全球第30位。按新加坡《亚洲金融时报》“世界500强”最新榜单，兴业银行以426.21亿美元位列全球排名第230位。同时，过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中，先后获得“亚洲卓越银行”“年度最佳股份制银行”“中国最佳零售企业”等多项殊荣。

(三) 托管业务部的部门设置及员工情况  
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理部、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监督处、投资管理处、养老金管理中心等处室，共有员工1,100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

(四) 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。截至2018年12月31日，兴业银行已托管开放式基金248只，托管基金财产规模894.38亿元。

五、相关服务机构  
(一) 基金发售代理机构  
1、直销机构  
中银基金管理有限公司  
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼  
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼  
法定代表人：李秀喜  
电话：021-38834999  
传真：021-68827488

2、中银基金管理有限公司直销中心柜台  
地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼  
客户服务电话：021-3883 4788，400-888-5566  
电子信箱：clicntservice@bocim.com  
联系人：李博

3、中银基金管理有限公司直销平台  
本公司电子直销平台包括：  
中银基金官方网站([www.bocim.com](http://www.bocim.com))  
“中银基金”官方微信服务号  
中银基金官方APP服务号

4、其他销售机构  
(1) 中国银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号  
法定代表人：陈四清  
客户服务电话：96566  
网站：[www.bocim.com](http://www.bocim.com)  
联系人：陈洪滨

(2) 招商银行股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区福苑路708号招商银行大厦  
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

况下的流动性风险，提高投资效率。

(1) 股指期货投资策略  
本基金将根据股指期货的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

(2) 国债期货投资策略  
本基金在进行股指期货投资时，将通过对其证券市场期货市场行情走势的研究，并结合股指期货的定价模型及其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑到股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

(3) 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。本基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对债券市场进行定性定量分析。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，力求实现基金资产的长期稳定增值。

(4) 投资资产配置  
本基金将根据对上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者本基金在进行复制交易、避险交易等情形下将主动获取权证。本基金进行权证投资时，将在对权证价格及其合理估值的基础上，结合组合投资策略、剩余期限、标的证券价格走势等因素，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险投资组合，力求取得最优的投资回报收益。

(5) 投资决策依据  
1、投资决策依据  
(1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；  
(2) 宏观经济形势及市场环境、债券市场和证券市场走势。

2、投资决策机制  
本基金管理人实行投资决策机制是：在投资决策委员会授权范围内，分管投资领导领导下的基金投资管理。

投资决策委员会负责研究报告，负责制定整体投资策略和原则，审定季度资产配置调整计划和再平衡投资组合的投资方案；分管投资领导，审定核心资产配置和范围，并定期调整投资策略和资产配置。

3、投资管理程序  
本基金在投资决策委员会的授权范围内，参考投资决策委员会的资产配置建议、行业投资比例和整体组合的绝对和相对风险控制水平，关注整个资产配置的风险收益水平、增值性、稳定性、分散性和流动性等特征，并结合自身对证券市场的分析判断，确定具体的投资品种、数量和买卖时点，构建和优化投资组合，并进行日常分析和调整。为有效控制组合风险，基金经理只有在获得投资决策委员会的批准，才可以超越权限超越个别证券。

基金经理助理/投资分析人员：通过内部调研和参考外部研究报告，定期提出宏观分析、行业分析、公司分析以及数据模拟的各类报告或建议，提交投资决策委员会，作为投资决策的依据。

数量分析人员通过数量模型发现投资机会，运用组合业绩评估系统，定期对投资组合中各类资产配置、行业配置、风格轮动、个股选择、个券选择、买卖成本等对整体业绩的贡献进行归因分析。投资组合管理人对投资组合的风险进行分析和控制，并根据反馈结果，基金经理及时对组合进行必要的调整。

3、投资管理程序  
本基金具体的投资决策机制与流程为：  
(1) 研究支持  
研究人员从基本面对宏观经济、行业、个券、和市场走势提出研究报告，数量小组利用集成市场预测模型和风险控制模型对市场、行业、个券进行分析并定期撰写投资建议。

(2) 投资决策  
投资决策委员会依据上述研究报告，定期(月)或遇重大事件时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理日常工作。

(3) 组合构建  
在投资决策委员会制定的投资原则和资产配置原则上，基金经理根据研究人员和数量小组的投资建议，结合自身对证券市场的分析判断，制定大类资产配置、行业配置及个股投资策略，在严格执行投资流程和投资纪律的基础上，严格控制风险构建投资组合，进行投资组合的构建和日常管理，并定期进行组合优化。

(4) 交易执行  
基金经理直接向交易部下达交易指令，交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行投资指令，进行具体品种的买卖，并将执行结果及时反馈基金经理确认。交易执行结束后，交易员填写交易回执，经基金经理确认后交给基金会计存档。

(5) 业绩评估  
数量小组和风险控制小组利用公司开发的业绩评估系统，对投资组合中整体资产配置、行业配置、风格选择、个股选择、买卖成本等对整体业绩的贡献进行评估。该评估结果将作为基金进行再平衡、风险控制和调整的依据。

(6) 组合维护  
基金经理将根据市场状况，结合行业、个股的基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及投资组合业绩评估的结果，对投资组合进行动态调整。

11、业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。  
沪深300指数是上海证券交易和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制方案透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且具有较高的知名度和市场影响力，选作为本基金股票投资的业绩比较基准。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等)，能够很好反映中国债券市场总体价格水平变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强，或者指数编制方法更能代表本基金投资组合业绩的指数推出并开放交易，本基金管理人可以在不影响基金份额持有人利益的前提下，对业绩比较基准进行相应调整，而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的投资业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参考，不决定也不必然反映本基金的投资策略。

十一、风险收益特征  
本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

十二、投资组合报告  
本基金的基金资产的董事会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。(2019年6月28日)  
本基金的托管人—兴业银行股份有限公司对本基金合同规定，于2019年6月28日复核了本报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

12.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	144,765,379.46	82.82
	其中:股票	144,765,379.46	82.82
2	固定收益投资	11,106,350.50	6.35
	其中:债券	11,106,350.50	6.35
	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	-	-
6	银行存单和结算备付金合计	15,867,963.22	9.08
7	其他各项资产	3,069,681.09	1.75
8	合计	174,798,374.27	100.00

12.2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
12.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	39,824.00	0.02
B	采矿业	4,204,876.00	2.42
C	制造业	54,901,933.57	32.12
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	9,723,813.00	5.69
E	建筑业	10,641,432.00	6.23
F	批发和零售业	16,166,624.26	9.25
G	交通运输、仓储和邮政业	4,587,128.00	2.68
H	信息和零售业	610,944.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,183,006.94	1.28
J	金融业	19,292,320.00	11.29
K	房地产业	12,634,799.00	7.39
L	租赁和商务服务业	4,608,362.00	2.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	421,600.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	132,600.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	6,661,092.00	3.90
S	综合	-	-
合计		144,765,379.46	84.70

12.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
本本基金本报告期末未持有港股通投资股票

12.3 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	002191	劲旅股份	242,200	3,436,818.00	2.01
2	600383	金地集团	211,900	2,913,625.00	1.70
3	600063	三一重工	221,100	2,825,658.00	1.65
4	600291	森马服饰	232,500	2,787,675.00	1.63
5	002643	万润股份	218,800	2,776,572.00	1.62
6	600081	汇鸿集团	510,100	2,774,944.00	1.62
7	601966	玲珑轮胎	149,300	2,656,047.00	1.56
8	600466	蓝光发展	359,800	2,655,324.00	1.55
9	600704	物产中大	467,800	2,647,748.00	1.56
10	601928	凤凰传媒	306,700	2,616,792.00	1.53

12.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	8,105,005.50	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债	3,000,300.00	1.76
其中:政策性金融债	3,000,300.00	1.76	
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,106,350.50	6.50

12.5 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	8,105,005.50	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债	3,000,300.00	1.76
其中:政策性金融债	3,000,300.00	1.76	
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,106,350.50	6.50

12.6 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	8,105,005.50	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债	3,000,300.00	1.76
其中:政策性金融债	3,000,300.00	1.76	
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,106,350.50	6.50

12.7 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债券投资组合

12.7 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债券投资组合