

中银丰禧定期开放债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第2号)

【本基金不向个人投资者公开销售】

基金管理人：中银基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
二〇一九年八月

重要提示

本基金经2017年11月1日中国证券监督管理委员会【2017】1966号文注册募集，基金合同于2017年12月27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投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但不保证本基金一定盈利，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和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本基金合同的承认和接受，并按《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。基金投资人要了解基金份额持有人的权利和义务，应详读查阅基金合同。

投资者有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件，全面了解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形成的系统性风险、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、基金管理人及基金托管人实施过程中产生的基金管理人风险、基金投资过程中产生的操作风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金投资对象与投资策略引致的特定风险等等。本基金的特有风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金属于债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金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前，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。

本基金每一投资者持有基金份额比例可达到或者超过50%，且本基金不向个人投资者销售。

本招募说明书所载内容截止至2019年6月26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）。本基金托管人交通银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同的生效日
2017年12月27日

二、基金管理人
(一)基金管理人概况

名称：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：章晖

设立日期：2004年8月12日
电话：(021)38834999
联系人：高爽秋

注册资本：14亿元人民币
股权结构：

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币80.00万元	80.0%
贝莱姆投资管理(美国)有限公司	相当于人民币160.00万元的美元	16.0%

(二)主要人员情况
1.董事会成员

章晖 (ZHANG Yan) 女士，董事长，国籍：中国。历任伦敦大学伦敦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。英国伦敦大学银行与金融学院市场主管、助理总经理、总监，总行金融市场总部、投资银行与资产管理部总经理。

李道滨 (Li Daobin) 先生，董事，国籍：中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

韩温 (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部副总经理。历任中国银行北京市分公司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总经理。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，中国银行总行金融市场总部高级交易员、主管，中国银行总行投资银行与资产管理部主管，中国银行上海分行金融市场部总经理等职。

曾冲波 (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，带领独立的风险管理团队，专责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、投资管理及财富管理业务。曾先生过去亦曾于美林的市场风险管理团队效力九年，并曾于瑞银的利率衍生工具交易及销售部门工作两年。曾先生现为美国清华大学及北京大学的风险管理客座讲师。他拥有美国威斯康辛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。

赵欣舸 (ZHAO Xing) 先生，独立董事，国籍：中国。美国西北大学经济学博士。曾在英国威康与玛莉学院商学院任教，并曾为美国投资公司协会（美国共同基金业行业协会）等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教授及金融MBA主任，并在华宝信托担任独立董事。

杜惠芬 (DU Hui fen) 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达斯斯经济学院工商管理硕士，澳大利亚国立大学高级访问学者，中央财经大学经济学博士。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。曾任山西财经大学统计学讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学独立学院（筹）教授、副院长，中央财经大学金融学院副院长等职。

付磊 (Fu Lei) 先生，独立董事，国籍：中国。首都经济贸易大学管理学学士。现任首都经济贸易大学会计学院教授、博士生导师。兼任中国商业会计学会常务理事、中国内部审计师协会、中国会计学会会计史专业委员会主任、北京会计学会常务理事、北京总会计师协会学术委员、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、航天长征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等职。

2.监事
赵蓓青 (ZHAO Beiqing) 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、天治基金管理有限责任公司交易员、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。

卢井泉 (LU Jingquan) 先生，监事，国籍：中国。南京政治学院法学硕士，历任空军指挥学院教员，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。

3.管理层成员
李道滨 (Li Daobin) 先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

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人员培训班(Wharton—SACExecutiveProgram)毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院(IveySchoolof Business, Western University)工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在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寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任鹏华证券基金有限责任公司（现光大证券）研发中心总经理、融通基金管理有限公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文 (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学位。历任中国银行苏州分行太子支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

陈军 (CHENJun) 先生，副执行总裁。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学金融学硕士。2004年加入中银基金管理有限公司，历任基金经理、权益投资部总经理、助理执行总裁。

王圣明 (WANG Shengming) 先生，副执行总裁。国籍：中国。北京师范大学教育管理硕士学位。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副总经理。

4.本基金的基金经理
郑涛 (ZHENG Tao) 先生，金融学博士。曾任广发证券股份有限公司交易员。2015年加入中银基金管理有限公司，曾任专户基金经理。2016年6月至今任中银美元债基金基金经理，2017年6月至今年任中银丰实基金基金经理，2017年6月至今年任中银丰和基金基金经理，2017年12月至今年任中银丰禧基金基金经理，2018年1月至今年任中银丰崇基金基金经理，2018年3月至今年任中银债7—10年期国债指数基金基金经理，2018年9月至今年任中银债3—5年期央行发行债券指数基金基金经理，2019年3月至今年任中银债1—3年期国开行债券指数基金基金经理，2019年6月至今年任中银债1—3年期农发行债券指数基金基金经理。中级经济师，具有10年证券从业年限，具备基金、证券、银行间本币市场交易员、黄金交易员从业资格。

5.投资决策委员会成员的姓名及职务
主席：李道滨（执行总裁）

成员：陈军（副执行总裁）、奚鹏洲（固定收益投资部总经理）、李建（权益投资部总经理）、张发余（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）

列席成员：欧阳向军（督察长）

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人
(一)基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：彭纯
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址：中国（上海）长宁区霞飞路18号
邮政编码：200336

注册日期：1987年3月30日
注册资本：742.63亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[1998]25号
联系人：陆志俊
电话：965959

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年6月在上海证券交易所挂牌上市。根据2018年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第11位，连续五年跻身全球银行20强；根据2018年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜，交通银行营业收入位列第168位，较上年提升3位。

截至2019年3月31日，交通银行资产总额为人民币97,857.47亿元。2019年1—3月，交通银行实现净利润归属于母公司（股东）人民币210.71亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况
彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事，2013年10月至2018年1月任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2006年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、执行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民大学研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。
任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行、中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

(三)基金托管业务经营情况
截至2019年3月31日，交通银行共托管证券投资基金418只。此外，交通银行还托管了基金公司特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、券商保障管理基金、企业年金基金、QDII证券投资资产、ROFII证券投资资产、ODII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

四、相关服务机构
(一)基金份额发售机构

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：章晖
电话：(021)38834999
传真：(021)50960970

1)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：021-38834788、400-888-5566
电子信箱：clientservice@bocim.com
联系人：周虹

2)本基金不通过电子直销平台办理本基金的销售业务。

2.其他销售机构
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并及时公告。

(二)登记机构
名称：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：章晖
电话：(021)38834999
传真：(021)50960970
联系人：乐妮

(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
电话：(021)31358666
传真：(021)31358600
经办律师：黎明、陈颖华
联系人：陈颖华

(四)审计会计师事务所
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
执行事务合伙人：毛鞍宁
电话：010-58153000
传真：010-85188298
联系人：徐旭
经办会计师：徐旭、许培菁

五、基金的名称
中银丰禧定期开放债券型发起式证券投资基金

六、基金的投资目标
本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不投资股票、权证等资产。
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，将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金投资组合资产配置比例：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。

开放期内，本基金每个交易日日终持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

九、基金的投资策略
(一)投资策略
本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，进行债券投资时机的选择和久期、类属配置，实施积极的债券投资组合管理，力争获取超越业绩比较基准的稳定投资收益。

1.类属配置策略
本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险、市场风险等因素及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力，通过比较并合理预期不同类属债券资产的风险与收益变化，确定并动态地调整不同类属债券类资产的配置。

2.久期管理策略
在全球经济的框架下，本基金管理人从宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断，密切跟踪CPI、PPI、汇率、M2等利率敏感指标，运用数量化工具，对未来市场利率趋势进行分析与预测，并据此确定合理的债券组合目标久期，通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

3.期限结构配置策略
本基金通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的期限结构配置。根据债券收益率曲线形态、各期限债券品种收益率变动，结合短期资金利率水平与变动趋势，分析预测收益率曲线的变化，测算子弹、哑铃或梯形等不同期限结构配置策略的风险收益，形成具体的期限结构配置策略。

4.信用债券投资策略
本基金通过宏观经济运行、发行主体的发展前景和偿债能力、国家信用支撑等多重因素的综合考量对信用债券进行信用评级，并在信用评级的基础上，建立信用债券池；然后基于既定的目标久期、信用利差精选个券进行投资。

本基金将以内外部信用评级为研，研究债券发行主体的基本面，以确定债券的违约风险和合理的信用利差水平，判断债券的投资价值。本基金将重点分析债券发行人所处行业的发展前景、市场竞争地位、财务质量（包括资产负债水平、资产变现能力、偿债能力、运营效率以及现金流状况）等重要素，综合评价其信用等级，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。

为控制本基金的信用风险，本基金将定期对所投资债券的信用资质和发行人的偿付能力

进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。封闭期内，如本基金持有债券的信用状况急剧恶化，甚至可能出现违约风险，进而影响本基金的买入持有到期策略，本基金管理人可以调整杠杆比例或者不进行杠杆放大。

5.杠杆投资策略
本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。为控制风险，本基金的杠杆比例在每个封闭期内原则上保持不变，但是在回购利率过高、流动性不足，或者市场环境状况不宜采用放大策略等情况下，基金管理人可以调整杠杆比例或者不进行杠杆放大。

6.资产支持证券投资策略
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

(二)投资决策依据、机制和程序
1.投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的相关规定；
(2)国内外宏观经济形势及对中国经济市场的影响；
(3)企业信用评级；
(4)国家货币政策及债券市场政策；
(5)商业机构的信贷扩张。

2.投资决策机制
本基金实行本基金实行业投资决策团队制，强调团队合作，充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合，设立了投资研究部，策略分析师、固定收益分析师、数量分析师和基金经理，充分发挥主观能动性，渗透到投资研究的关键环节，群策群力，为基金份额持有人谋取中长期稳定的较高投资回报。

3.投资决策程序
本基金具体的投资决策机制与流程为：
(1)宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向，提交策略报告。

(2)债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告。

(3)信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。

(4)数量分析师对衍生品市场和创新产品进行分析研究。

(5)在分析研究报告的基础上，基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。

(6)投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。

(7)如审议通过，基金经理在考虑资产配置的情况下，挑选合适的债券品种，灵活采取各种策略，构建投资组合。

(8)交易部执行交易指令。

十、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率。

中债综合全价（总值）指数是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更加全面，具有广泛的市場代表性，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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标的时间序列更加完整，有利于更加深入地进行研究和市场分析。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中债综合全价（总值）指数作为业绩比较基准，该业绩比较基准能够比较客观地反映本基金投资组合的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较的指数时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十一、风险收益特征
本基金属于债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。

十二、投资组合报告
本基金经理人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，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。

本基金的托管人—交通银行股份有限公司承担本基金合同规定，于2019年7月12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。

(一) 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,927,554,000.00	97.97
	其中：债券	2,927,554,000.00	97.97
	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	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,007,158.55	0.23
7	其他各项资产	53,631,511.06	1.79
8	合计	2,988,192,669.60	100.00

(二) 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投资股票。

(三) 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。

(四) 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	1,188,430,000.00	46.26
	其中：政策性金融债	424,337,000.00	16.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	894,438,000.00	34.08
6	中期票据	650,468,000.00	25.05
7	可转换债券(可交换债)	-	-
8	同业存单	2,294,218,000.00	89.84
9	合计	2,927,554,000.00	115.43

(五) 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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111802211	18农业银行CD211	2,000,000	196,520,000.00	7.71
2	120226	12国开26	2,000,000	194,080,000.00	7.65
3	160215	16国开15	1,800,000	180,162,000.00	7.10
4	101800091	18光明MTN002	1,200,000	121,886,000.00	4.81
5	11282020	11招商国债02	1,000,000	102,590,000.00	4.04

(六) 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

(八) 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.本基金投资国债期货的投资政策
本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资策略。

2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金报告期内未参与国债期货投资。

3.本基金投资国债期货的投资评价
本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

(十) 投资组合报告附注
1. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2. 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	53,631,511.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,631,511.06

4. 本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

6. 投资组合