民生加银增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

2020年第1号

基金管理人：民生加银基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二零二零年二月
重要提示

民生加银增强收益债券型证券投资基金经2009年6月9日中国证监会证监许可【2009】473号文核准募集，基金合同于2009年7月21日正式生效。

根据中国证监会2017年9月31日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称"《流动性风险管理规定》"），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符合该《流动性风险管理规定》的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起6个月内修改基金合同并公告。根据《流动性风险管理规定》等法律法规，经与基金托管人协商一致，并报告证监会备案，民生加银基金管理有限公司决定民生加银增强收益债券型证券投资基金的基金合同进行了修改。修改后的基金合同已于2018年3月23日起生效。

基金管理人保证本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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对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。

证券投资基金（以下简称"基金"）是一种长期投资，风险较低的一种证券品种。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告截至时间为2019年12月31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	289,001,517.65	14.18
	其中：股票	289,001,517.65	14.18
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,666,223,472.88	81.74
	其中：债券	1,636,184,472.88	80.27
	资产支持证券	30,039,000.00	1.47
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	4,000,000.00	0.20
	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	37,611,390.62	1.85
8	其他资产	41,560,928.41	2.04
9	合计	2,038,397,309.56	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

3 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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	205,566,015.65	12.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,717,237.00	0.17
J	金融业	48,110,851.00	3.02
K	房地产业	29,696,514.00	1.87
L	租赁和商务服务业	2,910,900.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	289,001,517.65	18.16

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	000725	京东方A	8,678,100	39,398,574.00	2.48
2	000100	TCL集团	6,300,000	28,161,000.00	1.77
3	300059	东方财富	1,363,500	21,502,395.00	1.35
4	000002	万科A	570,800	18,368,344.00	1.15
5	601100	恒立液压	243,742	12,126,164.50	0.76
6	002475	立讯精密	330,000	12,045,000.00	0.76
7	600760	中航沈飞	360,800	11,401,280.00	0.72
8	600809	山西汾酒	120,200	10,781,940.00	0.68
9	600271	航天信息	454,000	10,519,180.00	0.66
10	000661	长春高新	20,000	8,940,000.00	0.56

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	279,650,512.40	17.57
	其中：政策性金融债	279,650,512.40	17.57
4	企业债券	687,037,941.30	43.17
5	企业短期融资券	230,782,000.00	14.50
6	中期票据	80,920,000.00	5.08
7	可转债（可交换债）	248,132,019.18	15.59
8	同业存单	49,110,000.00	3.09
9	其他	60,552,000.00	3.80
10	合计	1,636,184,472.88	102.81

注：其他为地方政府债券。

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	190207	19国开07	700,000	70,518,000.00	4.43
2	190201	19国开01	700,000	70,021,000.00	4.40
3	018007	国开1801	627,460	63,216,595.00	3.97
4	108602	国开1704	627,580	63,121,996.40	3.97
5	113021	中信转债	557,010	63,020,111.40	3.96

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六名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	138240	碧桂A1	300,000	30,039,000.00	1.89

8 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
注：本基金本报告期末未持有贵金属。
9 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
注：本基金本报告期末未持有权证。
10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
11 投资组合报告附注
11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。
11.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	310,335.64
2	应收证券清算款	8,275,704.62
3	应收股利	–
4	应收利息	31,467,604.33
5	应收申购款	1,507,283.82
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	41,560,928.41

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113021	中信转债	63,020,111.40	3.96
2	113011	光大转债	34,818,784.60	2.19
3	123022	长信转债	22,927,612.50	1.44
4	127005	长证转债	19,108,098.24	1.20
5	128059	视源转债	14,974,800.00	0.94
6	110046	圣润转债	12,893,000.00	0.81
7	113009	广汽转债	10,447,200.00	0.66
8	132009	17中油EB	9,972,000.00	0.63
9	110055	伊力转债	7,971,600.00	0.50
10	128034	江银转债	6,758,400.00	0.42
11	128048	张行转债	6,424,824.00	0.40
12	127012	招路转债	5,729,500.00	0.36
13	110038	济川转债	3,942,598.20	0.25
14	128045	机电转债	3,552,000.00	0.22
15	110047	山鹰转债	3,394,440.00	0.21
16	113519	长久转债	2,836,890.00	0.18
17	110052	贵广转债	2,787,218.00	0.18
18	110050	佳都转债	1,484,965.00	0.09
19	110048	福能转债	1,212,400.00	0.08
20	110057	现代转债	477,461.80	0.03
21	113522	旭升转债	394,348.00	0.02
22	128058	岩邦转债	355,020.00	0.02
23	128030	天康转债	200,494.90	0.01
24	123002	国祯转债	82,764.80	0.01
25	123003	蓝思转债	1,322.30	0.00

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

A类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2009年度（自2009年7月21日至12月31日）	3.40%	0.18%	－0.41%	0.03%	3.81%	0.15%
2010年度	9.83%	0.34%	－0.52%	0.07%	10.35%	0.27%
2011年度	－5.07%	0.36%	2.40%	0.09%	－7.47%	0.27%
2012年度	13.74%	0.34%	0.37%	0.06%	13.37%	0.28%
2013年度	1.01%	0.54%	－3.75%	0.08%	4.76%	0.46%
2014年度	49.64%	1.15%	6.54%	0.11%	43.10%	1.04%
2015年度	18.09%	0.99%	4.19%	0.08%	13.90%	0.91%
2016年度	－2.76%	0.40%	－1.63%	0.09%	－1.13%	0.31%
2017年度	－1.58%	0.26%	－36.00%	9.75%	34.42%	－9.49%
2018年度	－7.24%	0.35%	4.79%	0.07%	－12.03%	0.28%
2019年度	19.30%	0.45%	1.31%	0.05%	17.99%	0.40%
自基金合同生效起至今（自2009年7月21日至2019年12月31日）	131.8%	0.58%	9.75%	0.08%	122.10%	0.50%

C类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2009年度（自2009年7月21日至12月31日）	3.20%	0.17%	－0.41%	0.03%	3.61%	0.14%
2010年度	9.46%	0.33%	－0.52%	0.07%	9.98%	0.26%
2011年度	－5.46%	0.36%	2.40%	0.09%	－7.86%	0.27%
2012年度	13.20%	0.34%	0.37%	0.06%	12.83%	0.28%
2013年度	0.58%	0.54%	－3.75%	0.08%	4.33%	0.46%
2014年度	49.08%	1.15%	6.54%	0.11%	42.54%	1.04%
2015年度	17.67%	0.99%	4.19%	0.08%	13.48%	0.91%
2016年度	－3.10%	0.40%	－1.63%	0.09%	－1.47%	0.31%
2017年度	－1.95%	0.27%	－36.00%	9.75%	34.05%	－9.48%
2018年度	－7.26%	0.35%	4.79%	0.07%	－12.05%	0.28%
2019年度	18.97%	0.45%	1.31%	0.05%	17.66%	0.40%
自基金合同生效起至今（自2009年7月21日至2019年12月31日）	123.57%	0.58%	9.75%	0.08%	113.82%	0.50%

注：业绩比较基准=中国债券综合指数收益率。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类
1.基金管理人的管理费；
2.基金托管人的托管费；
3.基金财产拨划支付的银行费用；
4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
5.基金份额持有人大会费用；
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7.基金的证券交易费用；
8.从C类基金份额基金资产中计提的销售服务费；
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
3.销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人基金管理人将依法进行代销机构的选聘。
销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年销售服务费率÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首起3个工作日内从基金财产中划出，由基金注册登记机构代收，基金注册登记机构代收后按相关合同规定支付给基金销售机构等；若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
11.7 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。
注：本基金本报告期末未持有国债期货。
11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本基金本报告期末未持有股票。
11.9 本期末基金投资的股票明细
11.9.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	205,566,015.65	12.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,717,237.00	0.17
J	金融业	48,110,851.00	3.02
K	房地产业	29,696,514.00	1.87
L	租赁和商务服务业	2,910,900.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	289,001,517.65	18.16

11.9.2 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	000725	京东方A	8,678,100	39,398,574.00	2.48
2	000100	TCL集团	6,300,000	28,161,000.00	1.77
3	300059	东方财富	1,363,500	21,502,395.00	1.35
4	000002	万科A	570,800	18,368,344.00	1.15
5	601100	恒立液压	243,742	12,126,164.50	0.76
6	002475	立讯精密	330,000	12,045,000.00	0.76
7	600760	中航沈飞	360,800	11,401,280.00	0.72
8	600809	山西汾酒	120,200	10,781,940.00	0.68
9	600271	航天信息	454,000	10,519,180.00	0.66
10	000661	长春高新	20,000	8,940,000.00	0.56

11.9.3 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	279,650,512.40	17.57
	其中：政策性金融债	279,650,512.40	17.57
4	企业债券	687,037,941.30	43.17
5	企业短期融资券	230,782,000.00	14.50
6	中期票据	80,920,000.00	5.08
7	可转债（可交换债）	248,132,019.18	15.59
8	同业存单	49,110,000.00	3.09
9	其他	60,552,000.00	3.80
10	合计	1,636,184,472.88	102.81

注：其他为地方政府债券。

11.9.4 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190207	19国开07	700,000	70,518,000.00	4.43
2	190201	19国开01	700,000	70,021,000.00	4.40
3	018007	国开1801	627,460	63,216,595.00	3.97
4	108602	国开1704	627,580	63,121,996.40	3.97
5	113021	中信转债	557,010	63,020,111.40	3.96

11.9.5 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资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	138240	碧桂A1	300,000	30,039,000.00	1.89

11.9.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前六名贵金属投资明细

序号	贵金属品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	黄金	30,039,000.00	1.89

11.9.7 报告期末本基金投资的期货交易情况说明
11.9.7.1 报告期末本基金投资期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。
11.9.7.2 报告期末本基金投资期货的持仓情况
本基金本报告期末未持有期货合约。
11.9.7.3 报告期末本基金投资期货的损益情况
本基金本报告期末未持有期货合约。
11.9.7.4 报告期末期货投资的风险指标
本基金本报告期末未持有期货合约。
11.9.8 报告期末本基金投资的贵金属交易情况说明
11.9.8.1 报告期末本基金投资贵金属的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确贵金属的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与贵金属交易。
11.9.8.2 报告期末本基金投资贵金属的持仓情况
本基金本报告期末未持有贵金属。
11.9.8.3 报告期末本基金投资贵金属的损益情况
本基金本报告期末未持有贵金属。
11.9.8.4 报告期末贵金属投资的风险指标
本基金本报告期末未持有贵金属。
11.9.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
11.9.9.1 报告期末本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。
11.9.9.2 报告期末本基金投资股指期货的持仓情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
11.9.9.3 报告期末本基金投资股指期货的损益情况
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
11.9.9.4 报告期末股指期货投资的风险指标
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
11.9.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
11.9.10.1 报告期末本基金投资国债期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。
11.9.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债期货。
11.9.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
11.10 投资组合报告附注
11.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。
11.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
11.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	310,335.64
2	应收证券清算款	8,275,704.62
3	应收股利	–
4	应收利息	31,467,604.33
5	应收申购款	1,507,283.82
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	41,560,928.41

11.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113021	中信转债	63,020,111.40	3.96
2	113011	光大转债	34,818,784.60	2.19
3	123022	长信转债	22,927,612.50	1.44
4	127005	长证转债	19,108,098.24	1.20
5	128059	视源转债	14,974,800.00	0.94
6	110046	圣润转债	12,893,000.00	0.81
7	113009	广汽转债	10,447,200.00	0.66
8	132009	17中油EB	9,972,000.00	0.63
9	110055	伊力转债	7,971,600.00	0.50
10	128034	江银转债	6,758,400.00	0.42
11	128048	张行转债	6,424,824.00	0.40
12	127012	招路转债	5,729,500.00	0.36
13	110038	济川转债	3,942,598.20	0.25
14	128045	机电转债	3,552,000.00	0.22
15	110047	山鹰转债	3,394,440.00	0.21
16	113519	长久转债	2,836,890.00	0.18
17	110052	贵广转债	2,787,218.00	0.18
18	110050	佳都转债	1,484,965.00	0.09
19	110048	福能转债	1,212,400.00	0.08
20	110057	现代转债	477,461.80	0.03
21	113522	旭升转债	394,348.00	0.02
22	128058	岩邦转债	355,020.00	0.02
23	128030	天康转债	200,494.90	0.01
24	123002	国祯转债	82,764.80	0.01
25	123003	蓝思转债	1,322.30	0.00

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

A类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2009年度（自2009年7月21日至12月31日）	3.40%	0.18%	－0.41%	0.03%	3.81%	0.15%
2010年度	9.83%	0.34%	－0.52%	0.07%	10.35%	0.27%
2011年度	－5.07%	0.36%	2.40%	0.09%	－7.47%	0.27%
2012年度	13.74%	0.34%	0.37%	0.06%	13.37%	0.28%
2013年度	1.01%	0.54%	－3.75%	0.08%	4.76%	0.46%
2014年度	49.64%	1.15%	6.54%	0.11%	43.10%	1.04%
2015年度	18.09%	0.99%	4.19%	0.08%	13.90%	0.91%
2016年度	－2.76%	0.40%	－1.63%	0.09%	－1.13%	0.31%
2017年度	－1.58%	0.26%	－36.00%	9.75%	34.42%	－9.49%
2018年度	－7.24%	0.35%	4.79%	0.07%	－12.03%	0.28%
2019年度	19.30%	0.45%	1.31%	0.05%	17.99%	0.40%
自基金合同生效起至今（自2009年7月21日至2019年12月31日）	131.8%	0.58%	9.75%	0.08%	122.10%	0.50%

C类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2009年度（自2009年7月21日至12月31日）	3.20%	0.17%	－0.41%	0.03%	3.61%	0.14%
2010年度	9.46%	0.33%	－0.52%	0.07%	9.98%	0.26%
2011年度	－5.46%	0.36%	2.40%	0.09%	－7.86%	0.27%
2012年度	13.20%	0.34%	0.37%	0.06%	12.83%	0.28%
2013年度	0.58%	0.54%	－3.75%	0.08%	4.33%	0.46%
2014年度	49.08%	1.15%	6.54%	0.11%	42.54%	1.04%
2015年度	17.67%	0.99%	4.19%	0.08%	13.48%	0.91%
2016年度	－3.10%	0.40%	－1.63%	0.09%	－1.47%	0.31%
2017年度	－1.95%	0.27%	－36.00%	9.75%	34.05%	－9.48%
2018年度	－7.26%	0.35%	4.79%	0.07%	－12.05%	0.28%
2019年度	18.97%	0.45%	1.31%	0.05%	17.66%	0.40%
自基金合同生效起至今（自2009年7月21日至2019年12月31日）	123.57%	0.58%	9.75%	0.08%	113.82%	0.50%

注：业绩比较基准=中国债券综合指数收益率。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类
1.基金管理人的管理费；
2.基金托管人的托管费；
3.基金财产拨划支付的银行费用；
4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
5.基金份额持有人大会费用；
6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7.基金的证券交易费用；
8.从C类基金份额基金资产中计提的销售服务费；
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
3.销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人基金管理人将依法进行代销机构的选聘。
销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×年销售服务费率÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首起3个工作日内从基金财产中划出，由基金注册登记机构代收，基金注册登记机构代收后按相关合同规定支付给基金销售机构等；若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
11.7 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。
注：本基金本报告期末未持有国债期货。
11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本基金本报告期末未持有股票。
11.9 本期末基金投资的股票明细
11.9.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	205,566,015.65	12.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,717,237.00	0.17
J	金融业	48,110,851.00	3.02
K	房地产业	29,696,514.00	1.87
L	租赁和商务服务业	2,910,900.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	289,001,517.65	18.16

11.9.2 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	000725	京东方A	8,678,100	39,398,574.00	2.48
2	000100	TCL集团	6,300,000	28,161,000.00	1.77
3	300059	东方财富	1,363,500	21,502,395.00	1.35
4	000002	万科A	570,800	18,368,344.00	1.15
5	601100	恒立液压	243,742	12,126,164.50	0.76
6	002475	立讯精密	330,000	12,045,000.00	0.76
7	600760	中航沈飞	360,800	11,401,280.00	0.72
8	600809	山西汾酒	120,200	10,781,940.00	0.68
9	600271	航天信息	454,000	10,519,180.00	0.66
10	000661	长春高新	20,000	8,940,000.00	0.56

11.9.3 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	279,650,512.40	17.57
	其中：政策性金融债	279,650,512.40	17.57
4	企业债券	687,037,941.30	43.17
5	企业短期融资券	230,782,000.00	14.50
6	中期票据	80,920,000.00	5.08
7	可转债（可交换债）	248,132,019.18	15.59
8	同业存单	49,110,000.00	3.09
9	其他	60,552,000.00	3.80
10	合计	1,636,184,472.88	102.81

注：其他为地方政府债券。

11.9.4 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190207	19国开07	700,000	70,518,000.00	4.43
2	190201	19国开01	700,000	70,021,000.00	4.40
3	018007	国开1801	627,460	63,216,595.00	3.97
4	108602	国开1704	627,580	63,121,996.40	3.97
5	113021	中信转债	557,010	63,020,111.40	3.96

11.9.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大