

B090 信息披露 | Disclosure

中欧安财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

基金管理人：中欧基金管理有限公司
基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二〇二〇年四月
本基金经2018年4月17日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予中欧安财定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]724文）准予募集注册。本基金基金合同于2018年5月15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，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。

本基金为发起式基金，在基金募集时，基金管理人运用其固有资金认购本基金份额的金额不低于1000万元，认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年。但基金管理人对本基金的发展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、招募说明书及基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身投资目的、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本基金，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、发起式基金自动终止的风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人存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者注意基金投资的“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。

本基金单一投资者持有的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公开销售。
本基金本次更新招募说明书仅根据2019年9月1日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金会的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日（财务数据未经审计）。
本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

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号五层
- 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层-嘉盛大厦7层
- 法定代表人：裘玉明
- 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：袁媛
- 客户服务热线：021-68609700、400-700-9700（免长途话费）
- 注册资本：2,000万元人民币
- 股权结构：

序号	股东名称	出资额 (人民币万元)	出资比例
1	Unione di Banche Italiane S.p.A.	5,500	25.0000%
2	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
3	北京百骏投资有限公司	4,400	20.0000%
4	上海融亿投资管理合伙企业(有限合伙)	4,400	20.0000%
5	裘玉明	1,100	5.0000%
6	万盛基业投资有限责任公司	726	3.3000%
7	周玉雄	328.35	1.4925%
8	卢艳青	163.8340	0.7447%
9	于洁	163.8340	0.7447%
10	赵国英	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	于晓云	92.4660	0.4203%
14	魏博	87.7580	0.3989%
15	郑苏丹	87.7580	0.3989%
16	曲捷	87.7580	0.3989%
17	黎忆海	64.3720	0.2926%
	合计	22,000	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，中国籍。中欧基金管理有限公司董事长、上海盛立基金理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事、天合光能股份有限公司董事。曾任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，历任布雷西亚农业银行信贷经理（CAB）国际部总监，曾在意大利信贷银行（Credito Italiano，现名：联合信贷银行UniCredit）圣雷莫分行、米兰分行、伦敦分行、纽约分行、东京分行（财务负责人）及米兰总部工作。

朱鹏举先生，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，担任行业董事及内核小组组长。

刘建平先生，北京大学法学学士、法学硕士，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院工商管理博士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理，历任北京大学教师，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、The Red Flag Group非执行董事，英国公认会计师特许公会—资深会员及香港会计师公会会员，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属维尔京群岛、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，德国汉堡学者，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，贵阳银行股份有限公司独立董事，荣威国际集团股份有限公司独立董事，中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事，交银国际信托有限公司独立董事。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计划兼副院长。

2.基金管理人监事会成员

唐寿先生，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，历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东广州天伦律师事务所合伙人，美国纽约州Schutte 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运营总监，中国籍，上海财经大学证券期货专业学士。历任申银万国证券股份有限公司中贸易营业部经纪人。

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，同济大学计算机应用专业学士。历任大连证券上海普瑞路营业部系统管理员，大通证券上海普瑞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，兼任中欧基金管理有限公司策略组负责人，中国籍。上海财经大学金融学硕士，18年以上证券及基金从业经验。历任平安集团投资管理公司中债券研究员、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，策略组负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融硕士学位，14年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限公司子公司研究员，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经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，18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。

于莹女士，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，11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

姓名	赵国英	性别	女
国籍	中国	毕业院校及专业	清华五道口金融学院金融学专业
其他公司历任	天安保险有限公司债券交易员（2004.07-2005.05），兴业银行资金营运中心债券交易员（2005.06-2009.12），美国银行上海分行环球金融市场部副总监（2009.12-2015.04）		
本公司历任	投资经理		
本公司现任	策略组负责人、基金经理		
本基金管理过管理基金具体情况	产品名称	起任日期	离任日期
1	中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）	2018年08月21日	
2	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	
3	中欧瑞势多策略定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	2018年11月22日
4	中欧瑞福定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	2019年02月11日
5	中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）	2018年08月21日	2019年08月26日
6	中欧兴利债券型证券投资基金	2018年08月21日	
7	中欧瑞福回报债券型证券投资基金（LOF）	2018年08月21日	
8	中欧兴华定期开放债券型发起式证券投资基金	2018年10月30日	
9	中欧盛利灵活配置定期开放债券型发起式证券投资基金（LOF）	2019年07月11日	

姓名	李华成	性别	男
国籍	中国	毕业院校及专业	上海社会科学经济学院专业

其他公司历任	浦银安盛基金管理有限公司固定收益研究员、专户产品投资管理（2014.07-2016.04）		
本公司历任	投资经理助理、投资经理		
本公司现任	基金经理		
本基金管理过管理基金具体情况	产品名称	起任日期	离任日期

1	中欧瑞福灵活配置混合型证券投资基金	2018年03月29日	
2	中欧兴华定期开放债券型发起式证券投资基金	2018年10月17日	
3	中欧瑞福定期开放债券型证券投资基金（LOF）	2018年12月04日	

（2）历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
朱晨浩	2017年04月07日	2018年08月21日
刘蕾云	2016年02月16日	2018年06月27日
尹建康	2015年06月25日	2018年06月17日
黄克宁	2013年01月31日	2015年06月26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最高投资决策机构，由总经理刘建平，副总经理兼策略组负责人顾伟，副总经理兼研究总监、策略组负责人卢纯青，策略组负责人周岚文、陆文俊、周玉雄、刁羽、黄华、陈庆、赵国英、曹会长、王培、王皓，信用评估部总监张闻，风险管理部总监孙自刚，中央交易室总监陆正芳组成。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。

第二部分 基金托管人

1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城金融大街3号A座
法定代表人：张金良
成立时间：2007年3月6日
组织形式：股份有限公司
注册资本：8,013.31亿元
存续期间：持续经营
批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复〔2006〕484号
基金托管资格批文及文号：证监许可〔2009〕1673号
联系人：王昊
联系电话：010-68888126
经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会批准，开展其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力合同和业务中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行业务定位，发挥邮网优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、产品管理处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工23人，全部员工拥有大专以上学历及基金从业资格，90%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

3、托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。2012年7月10日，中国邮政储蓄银行经中国保险监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心，以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队，灵活的托管业务系统、规范化的资产管理制度，健全的内控体系，运作高效的业务处理流程，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2019年3月31日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共85只。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达4072.75亿元。

第三部分 相关服务机构

一、基金销售机构

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层-嘉盛大厦7层
法定代表人：裘玉明
联系人：袁媛
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

基金管理人可以根据情况变化，增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公告。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5层
办公地址：上海市虹口区公平路18号8层-嘉盛大厦7层
法定代表人：裘玉明
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、陈颖华
电话：021-31358660
传真：021-31358606
联系人：陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所
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01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人：毛鞍平
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐皓

第四部分 基金的名称

中欧纯债债券型证券投资基金（LOF）

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。

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金融工具，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可转换债券、可分离交易可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等金融资产以及法律法规和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）。
本基金不直接投资股票、权证等权益类资产，但可持有因可转债转股、可交换债券转股所形成的股票，因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转换债券而产生的权证等。因上述原因持有股票和权证资产，本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。
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，可以将其纳入本基金投资范围。

基金的投资组合比例

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但在开放期前10个工作日和后10个工作日以及开放期前债券投资不受上述比例限制。在开放期，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或投资于一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除

国债期货合约需缴纳的交易所保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

第八部分 基金的投资策略

本基金管理人将根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期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组合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。在市场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，然后通过对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和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法，“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，银行存款、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

基金管理人自建债券研究资料库，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、税收因素等，进行个券选择。

3、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，从而使其债券的收益率水平将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。当预期利差水平缩小时，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；当预期利差水平扩大时，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。

本基金通过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将根据风险管理的原则，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：中债综合财富收益率
中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任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 risk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在基金托管人同意，并报中国证监会备案，而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个工作日内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。

第十一部分 基金的投资组合报告

基金管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。

基金托管人根据本基金合同规定，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2019年第1季度报告，所载数据截至2019年3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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,453,536,240.21	91.35
	其中：债券	1,453,536,240.21	91.35
4	固定收益投资	1,453,536,240.21	91.35
	其中：政策性金融债	99,368,489.94	6.28
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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,868,423.00	0.62
8	其他资产	27,868,814.65	1.75
9	合计	1,591,221,947.80	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

序号	股票代码	股票名称	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	126,700,000.00	10.88	
	其中：政策性金融债	20,628,000.00	1.77	
4	企业债	605,914,000.00	52.05	
5	企业短期融资券	20,300,000.00	1.74	
6	中期票据	674,632,000.00	57.95	
7	可转债（可交换债）	25,398,240.21	2.23	
8	其他存单	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	合计	1,453,536,240.21	124.86	

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明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)
----	------	------	-------	---------