（上接A99版）

（96）华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:韩鹏
联系人:杨晓天
联系电话:0931-8784509
传真:0931-4890619
甘肃省客服电话:96668
网址:www.hlzqgs.com
（97）中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街甲6号SK大厦
法定代表人:丁学东
联系人:杨涵宇
电话:010-65051166
网址:www.ciccs.com.cn
（98）财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
客户联系电话:0571－96336（上海地区:962336）
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
传真:0571-87925100
网址:www.ctsec.com
（99）上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:郭林
客服电话:4008205999
联系人:李颖
电话:021-38784814
传真:021-68774818
网址:www.shhxzq.com
（100）华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞洋
联系人:陈敏
网站:www.cfsc.com.cn
客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
（101）瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程宜荪
电话:010-58328373
传真:010-58328748
联系人:冯爽
客服电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com
（102）中国中金财富证券有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:高涛
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn
（103）中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人:林炳城
电话:0755-82943755
传真:0755-82960582
客户服务电话：95329
网址:www.zszq.com
（104）国融证券股份有限公司
注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼
法定代表人:张智河
联系电话:95385； 400-660-9839
网址:www.grzq.com
（105）粤开证券股份有限公司
注册地址:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层
法定代表人:严亦斌
联系人:彭莲
联系电话:0755-83331195
客户服务电话:95564
公司网址:http://www.ykzq.com
（106）江海证券有限公司
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表:孙名扬
电话:0451-85863726
客服热线:956007
联系人:周俊
网址:www.jhzq.com.cn
（107）九州证券股份有限公司
注册地址:青海省西宁市南川工业园区创业路108号
办公地址:北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
法人代表人:魏先锋
电话:010-57672000
传真:010-57672296
统一客服电话:95305
（108）国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
客服电话:4006600109
联系人:刘婧漪电话：028-86690057
传真:028-86690126
客服电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn
（109）华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客服电话:400-820-9898
联系人:刘闻川
电话:021-68778075
传真:021-68868117
网址:www.cnhbstock.com
（110）爱建证券有限责任公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:钱华
客服电话:4001-962-502
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-62878783
网址:www.ajzq.com
（111）英大证券有限责任公司
地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:吴俊
客服电话:4000-188-688
联系人:吴尔晖
电话:0755-83007159
传真:0755-83007034
网址:www.ydsc.com.cn
（112）华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:010-58315221
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118 、400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn
（113）天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:翟璟
联系电话:（027）87618882/(028) 86711410
传真:（027）87618863
网址:www.tfzq.com
（114）大通证券股份有限公司
注册地址:大连市中山区人民路24号
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层
法定代表人:李红光
联系人:谢立军
电话:0411-39991807
传真:0411-39673219
客户服务热线:4008-169-169
网址:www.daton.com.cn
（115）宏信证券有限责任公司
办公地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
法人代表人:吴玉明
客服电话:4008366366
联系人:刘文涛
电话:02886199765
传真:02886199533
网址:http://www.hx818.com
（116）联储证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
办公地址:北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层联储证券
法定代表人:吕春卫
联系人:丁倩云
联系电话：010-86499427 13051859661
传真:0755-23947482
客服电话:400-620-6868
网址:http://www.lczq.com/
（117）华瑞保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址:上海市浦东新区向城路288号国华人寿金融大厦8层806
法定代表人:路昊
联系人:茆勇强
联系电话：021-68595698
传真:021-68595766
客服电话:52303
网址:http://www.huaruisales.com/
（118）玄元保险代理有限公司
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永谙
联系人:卢亚博
联系电话:021-50701003
传真:021-50701053
客服电话:400-080-8208
网址:www.licaimofang.cn
（119）阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李科
电话:010-85632771
传真:010-85632773
联系人:王超
客服热线:95510
公司网站:http://fund.sinosig.com/
（120）方德保险代理有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号楼7层711
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号楼7层711
法定代表人:林柏均
联系人:胡明哲
联系电话:010-56203275
传真:010-68091380
客服电话:400-106-0101
网址:www.jhfund.com
（121）中国人寿保险股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街16号
办公地址:北京市西城区金融大街16号
法定代表人:王滨
客服电话:95519
联系人:秦泽伟
电话:010-63631539
传真:010-66222276
网址:www.e-chinalife.com
（122）深圳前海微众银行股份有限公司
注册地址:深圳市南山区桃园路田厦国际中心A36楼
法定代表人:顾敏
客服电话:400-999-8877
联系人：罗曦
电话:0755－89462447
网址:http://www.webank.com
（123）天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人:林义相
客服电话:010-66045678
联系人:尹伶
传真:010-66045527
网址:www.txsec.com
（124）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
法定代表人:杨懿
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
联系人:张燕
联系电话:010-58325388*1588
网站:www.new-rand.cn
客服电话:400-166-1188
（125）和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
联系电话:021-20835785
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com
（126）上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室
法定代表人:冷飞
客服电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
（127）腾安基金销售（深圳）有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区高新科技园科技中一路腾讯大厦11层
法人代表：刘明军
公告联系人:谭广峰
公告电话:95017-1-8
公告传真:0755-86013399
客服电话:95017
网址:www.tenganxinxi.com
（128）北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
办公地址:北京市海淀区信息路甲9号奎科大厦
法人代表:张旭阳
公告联系人:杨琳
公告电话:010-61952702
公告传真:010-61951007
客服电话:95055-9
网址:www.baiyingfund.com
（129）诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人:汪静波
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
联系人:徐诚
联系电话:021-38509639
网站：www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399
（130）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
网址:www.zlfund.cn
客服电话:4006-788-887
（131）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195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64383798
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
（132）上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903－906
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
联系人：张茹
联系电话：021-58870011
传真：021-68596916
网址：www.ehowbuy.com
（133）蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法人代表:陈柏青
联系人:韩爱彬
电话:021-60897840
传真:0571-26697013
客服电话:4000-766-123
网址：www.fund123.cn
（134）上海长量基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
客服电话:4008202899
联系人:邱燕芳
电话:021-20691931
传真:021-20691861
网址:www.erichfund.com
（135）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8580
传真:0571-88911818-8002
客服电话:4008-773-772
网站地址:www.5ifund.com
（136）上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢14层
法定代表人:李兴春
传真:021-50583633
电话:021-50583533
客服电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn
（137）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人:赵学军
电话：010-65215588
传真：010-85712195
联系人：李雯
联系人邮箱：liwen@harvestwm.cn
客服电话：400-021-8850
网址：www.harvestwm.cn
（138）泛华普益基金销售有限公司
注册地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址:四川省成都市金牛区西宸龙湖国际大厦B座12楼
法定代表人:于海锋
联系人:陶亚方
电话:13910181936
客服电话:400-080-3388
网址:www.puyifund.com
（139）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
客服电话:95177
网址:https://www.snjijin.com/
（140）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:周斌
客服电话:4008980618
网址:www.chtfund.com
（141）北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
网址:http://www.hcjijin.com
（142）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人:蒋煜
联系人:孙悦
电话:010-58170823
传真:010-58170800
客服电话:400-818-8866
网址:http://fund.shengshiview.com
（143）北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦（丹棱soho）1008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
网站:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885
（144）北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
法定代表人:张冠宇
客服电话:400-819－9868
联系人:王丽敏
电话:010-85932810
网址:www.tdyhfund.com
（145）北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号
法定代表人:杨纪峰
联系人:吴鹏
电话:18701358525
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-inv.com
（146）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
联系人:李唯
联系电话：010-58982465
传真:010-62676582
客服电话:010-62675369
网址:http://www.fund.sina.com.cn
（147）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：黄祎
联系人：徐亚丹
联系电话：021-50712782
传真：021-50710161
客服电话：400-799-1888
网址：www.520fund.com.cn
（148）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院18号楼
法定代表人:张旭
联系人:汪莹
联系电话：010-58160084
传真:010-58160173
客服电话:400-810-5919
网址:http://www.fengfd.com/
（149）上海联泰基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
邮编:200335
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:400-166-6788
公司网址：www.66zichan.com
（150）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
电话:0411-88891212
传真:0411-84396536
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com
（151）上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 a1002 室
法定代表人:王翔
联系人:安彬
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
（152）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:400-643-3389
联系人:葛佳蕊
电话:021-63333319
传真:021-63332523
网址:www.vstonewealth.com
（153）上海中正达广基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼
法定代表人:黄欣
公司电话:021-3376 8132
客服电话:400-6767-523
网址:http://www.zhongzhengfund.com
（154）北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
传真：010-65951887
电话:010-65951887
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
（155）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号
法定代表人:陶捷
联系人:杨帆
电话:027-87006003/87006009
网站:www.buyfunds.cn
公司传真:027-87006010
客服电话:400-027-9899
（156）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:王之光
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
联系人:宁博宇
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
（157）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人:黄敏嫦
网站：www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066
（158）和耕传承基金销售有限公司
注册地址:河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座
法定代表人:王旋
客服电话:4000-555-671
网址:http://www.hgccpb.com/
（159）奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
（160）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
电 话:个人业务:95118 ，400 098 8511
企业业务:400 088 8816
传 真：010-8919566
网址:fund.jd.com
（161）深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕霞
电话:0755-29330513
传真:0755-26920530
客服电话:400-9302-888
网址:https://www.jfz.com/
（162）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院6 号楼2 单元 21 层222507
法定代表人:钟斐斐
客服电话:4000618518
联系人:袁永娇
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址:https://danjuanapp.com
（163）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:毛淮平
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B8层
客服热线:400-817-5666
公司网址:www.amcfortune.com
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代理销售本基金,并及时公告。
（二）注册登记机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:黄慕平
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所名称:通力律师事务所
注册地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
办公地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
经办律师:秦悦民、傅轶
电话:021-68818100
传真:021-68816880
（四）会计师事务所和经办注册会计师
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:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:陈薇瑶
经办注册会计师:张振波、陈薇瑶
四、基金的名称
大成债券投资基金
五、基金的类型
基金类型:债券型
六、基金的运作方式
基金运作方式:契约型开放式
七、基金的投资目标
在力保本金安全和保持资产流动性基础上追求资产的长期稳定增值。
八、基金的投资方向
投资于债券类资产部分（包括流动性良好的、国内市场依法发行及交易的国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、正逆回购等,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具）不低于基金资产总值80%,本基金还可择机进行新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值20%。
九、基金的投资策略
本基金通过整体资产配置、类属资产配置和个券选择三个层次进行投资管理,以实现投资目标。具体按照如下步骤执行:
（一）在整体资产配置层次上,通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析、申购、赎回现金流情况等因素的综合分析,决定债券、逆回购、现金三类资产的配置比例。
（二）在类属资产配置层次,根据市场和类属资产的风险收益特征,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债四个子市场。在此基础上运用修正的均值－方差等模型，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。
（三）在债券选择上,采取积极策略,包括利率预期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略等。
（四）本基金在满足基金日常申购、赎回流动性基础上根据新股基本面研究择机进行新股申购。
基金管理人可根据债券市场的变化对市场细分与模型运用等进行适当调整。
十、基金的业绩比较基准
中国债券总指数
十一、基金的风险收益特征
本基金80%以上投资于债券，为债券基金，预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票基金。
十二、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。
基金托管人中国农业银行根据基金合同规定,于2020年6月18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取自大成债券投资基金2020年1季度报告,截止时间2020年3月31日。（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	25,414,526.18	0.89
	其中:股票	25,414,526.18	0.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,781,604,500.98	97.01
	其中:债券	2,781,604,500.98	97.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	4,279,010.20	0.15
8	其他资产	55,954,541.36	1.95
9	合计	2,867,252,578.72	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
（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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,414,526.18	1.08
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	25,414,526.18	1.08

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。
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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002271	东方雨虹	603,686	20,543,434.58	0.87
2	600438	通威股份	419,560	4,871,091.60	0.21

4. 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	659,420,000.00	28.02
	其中:政策性金融债	659,420,000.00	28.02
4	企业债券	591,647,785.70	25.14
5	企业短期融资券	160,855,000.00	6.83
6	中期票据	1,081,145,000.00	45.93
7	可转债（可交换债）	288,536,715.28	12.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,781,604,500.98	118.18

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）	占基金资产净值比例（%）
1	190205	19国开05	1,600,000	164,096,000.00	6.97
2	190215	19国开15	1,400,000	144,592,000.00	6.14
3	180210	18国开10	1,200,000	127,608,000.00	5.42
4	1480306	14深业债	900,000	92,016,000.00	3.91
5	101754060	17丰台国资MTN001	900,000	91,215,000.00	3.88

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资国债期货
（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末投资国债期货
（3）本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货
10. 投资组合报告附注
（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
（2）基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
（3）基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,374.53
2	应收证券清算款	638,706.67
3	应收股利	-
4	应收利息	50,062,661.20
5	应收申购款	5,203,798.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,954,541.36

（4）报告期末基金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	113011	光大转债	12,295,500.00	0.52
2	113014	林洋转债	11,144,232.80	0.47
3	113508	新凤转债	10,171,216.80	0.43
4	128046	利尔转债	9,046,065.84	0.38
5	110038	济川转债	6,959,878.20	0.30
6	128028	赣锋转债	6,800,318.42	0.29
7	123025	精测转债	6,755,552.28	0.29
8	128017	金禾转债	6,051,148.88	0.26
9	128059	视源转债	6,048,462.96	0.26
10	113504	艾华转债	5,940,719.40	0.25
11	113028	环境转债	5,665,950.00	0.24
12	110045	海澜转债	4,428,588.40	0.19
13	113025	明泰转债	4,347,367.20	0.18
14	110031	航信转债	3,979,991.40	0.17
15	128048	张行转债	3,470,187.81	0.15
16	110048	福能转债	3,406,112.50	0.14
17	128057	博彦转债	3,238,425.60	0.14
18	113537	文灿转债	3,232,735.20	0.14
19	128075	远东转债	2,970,676.50	0.13
20	128045	机电转债	2,894,209.20	0.12
21	113020	桐昆转债	2,440,008.80	0.10
22	113009	广汽转债	2,377,024.00	0.10
23	110047	山鹰转债	2,293,784.50	0.10
24	113534	鼎胜转债	2,265,800.00	0.10
25	128035	大族转债	2,230,549.65	0.09
26	128044	岭南转债	2,211,386.88	0.09
27	128029	太阳转债	1,906,807.10	0.08
28	123010	博世转债	1,550,208.00	0.07
29	113509	新泉转债	1,324,692.20	0.06
30	128058	拓邦转债	849,655.24	0.04
31	132005	15国资EB	736,937.60	0.03
32	113543	欧派转债	609,000.00	0.03
33	113544	桃李转债	251,580.00	0.01

（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中未存在流通受限情况。
（6）由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

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。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。
（一）基金合同生效日（2003年6月12日）至2020年3月31日以来完整会计年度的投资业绩及与同期业绩比较基准收益率的比较:
A、B类

阶段	净值增长率①	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
2003.6.12－2003.12.31	2.90%	0.16%	-1.41%	0.29%	4.31%	-0.13%
2004.1.1－2004.12.31	1.81%	0.32%	-3.32%	0.35%	5.13%	-0.03%
2005.1.1－2005.12.31	11.33%	0.29%	10.55%	0.21%	0.78%	0.08%
2006.1.1－2006.12.31	6.29%	0.14%	2.62%	0.10%	3.67%	0.04%
2007.1.1－2007.12.31	8.79%	0.17%	-1.81%	0.08%	10.60%	0.09%
2008.1.1－2008.12.31	11.10%	0.15%	14.89%	0.20%	-3.79%	-0.05%
2009.1.1－2009.12.31	2.72%	0.14%	-1.24%	0.10%	3.96%	0.04%
2010.1.1－2010.12.31	6.56%	0.18%	1.92%	0.10%	4.64%	0.08%
2011.1.1－2011.12.31	0.94%	0.14%	5.72%	0.11%	-4.78%	0.03%
2012.1.1－2012.12.31	4.85%	0.07%	2.51%	0.07%	2.34%	0.00%
2013.1.1－2013.12.31	0.92%	0.18%	-2.10%	0.11%	3.02%	0.07%
2014.1.1－2014.12.31	31.91%	0.54%	11.23%	0.15%	20.68%	0.39%
2015.1.1－2015.12.31	11.65%	0.88%	8.03%	0.11%	3.62%	0.77%
2016.01.01-2016.12.31	0.62%	0.10%	1.30%	0.12%	-0.68%	-0.02%
2017.01.01-2017.12.31	1.83%	0.12%	-1.19%	0.09%	3.02%	0.03%
2018.01.01-2018.12.31	10.06%	0.10%	9.63%	0.11%	0.43%	-0.01%
2019.01.01-2019.12.31	4.90%	0.14%	4.36%	0.08%	0.54%	0.06%
2020.01.01-2020.03.31	1.56%	0.24%	3.51%	0.17%	-1.95%	0.07%
2003.06.12-2020.03.31	210.15%	0.30%	87.30%	0.16%	122.85%	0.14%

C类

阶段	净值增长率①	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
2003.6.12－2003.12.31	2.90%	0.16%	-1.41%	0.29%	4.31%	-0.13%
2004.1.1－2004.12.31	1.81%	0.32%	-3.32%	0.35%	5.13%	-0.03%
2005.1.1－2005.12.31	11.33%	0.29%	10.55%	0.21%	0.78%	0.08%
2006.1.1－2006.12.31	5.86%	0.14%	2.62%	0.10%	3.24%	0.04%
2007.1.1－2007.12.31	8.17%	0.17%	-1.81%	0.08%	9.98%	0.09%
2008.1.1－2008.12.31	10.56%	0.15%	14.89%	0.20%	-4.33%	-0.05%
2009.1.1－2009.12.31	2.24%	0.14%	-1.24%	0.10%	3.48%	0.04%
2010.1.1－2010.12.31	6.19%	0.18%	1.92%	0.10%	4.27%	0.08%
2011.1.1－2011.12.31	0.62%	0.14%	5.72%	0.11%	-5.10%	0.03%
2012.1.1－2012.12.31	4.47%	0.07%	2.51%	0.07%	1.96%	0.00%
2013.1.1－2013.12.31	0.59%	0.18%	-2.10%	0.11%	2.69%	0.07%
2004.1.1－2014.12.31	31.41%	0.54%	11.23%	0.15%	20.18%	0.39%
2015.1.1－2015.12.31	11.26%	0.88%	8.03%	0.11%	3.23%	0.77%
2016.01.01-2016.12.31	0.31%	0.10%	1.30%	0.12%	-0.99%	-0.02%
2017.01.01-2017.12.31	1.54%	0.12%	-1.19%	0.09%	2.73%	0.03%
2018.01.01-2018.12.31	9.73%