

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
二〇一五年四月

重要提示
易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由易方达裕惠回报债券型证券投资基金转换运作方式，变更基金类别及修改其他相关事项而来。《关于易方达裕惠回报债券型证券投资基金转换运作方式、变更基金类别及修改其他相关事项的议案》经2014年8月18日易方达裕惠回报债券型证券投资基金份额持有人大会决议通过。自2014年8月18日起，由《易方达裕惠回报债券型证券投资基金合同》修订而成的《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金合同》生效。

本招募说明书根据本基金的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基金合同的承认和接受，并按照《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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

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。

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。

本基金的投资范围包括固定收益类资产、股票、权证等。投资人通过非直销销售机构或本公司网上交易系统首次申购的单笔最低限额为人民币100元，追加申购单笔最低限额均为人民币100元。通过本公司直销中心首次申购的单笔最低限额为人民币1,000,000元，追加申购单笔最低限额为人民币1,000元。

投资人在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场产生影响的市场风险；由于基金份额持有人大量赎回或证券市场交易不足导致的流动性风险；基金管理人在基金运作过程中产生的基金管理风险，以及基金合同终止的风险，等等。此外，本基金的特有风险，包括基金份额持有人存在封闭运作期间无法变现的风险、发生巨额赎回而赎回款项面临延缓支付或者终止基金合同的风险、特定情形下基金合同终止的风险，等等。本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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。此外，本基金以1.00元初始净值进行募集，在证券市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破1.00元初始净值的风险。

基金不同干银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

除另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2015年2月18日，有关财务数据截止日为2014年12月31日，净值表现截止日为2014年12月31日。（本报告中财务数据未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况
1.基金管理人：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中三路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

设立日期：2001年4月17日
法定代表人：叶俊英
联系电话：400 881 8088
联系人：贺智
注册资本：12,000万元人民币
2.股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总计	100%

（二）主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员
叶俊英先生，经济学博士，董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司政策法规部、副科长、科长，广东省烟草专卖局专卖办干部，广发证券有限责任公司董事、银行部总经理。公司董事、副总裁，易方达基金管理有限公司总裁、董事、副董事长。现任易方达基金管理有限公司董事长。

刘淑艳女士，经济学博士，董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理，易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司董事、总裁，易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券股份有限公司常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理、广发控股（香港）有限公司董事，广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。

杨力先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任美的集团采购事业部技术主管、企划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监、美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监，广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事，广源证券有限责任公司副董事长，盈峰资本管理有限公司总经理。

刘东辉先生，管理学博士，董事。曾任广州市东建实业总公司发展部投资计划员，广州商中心（马来西亚）有限公司副总经理、董事总经理，广州东建南洋经贸发展有限公司董事总经理，广东粤财信托有限公司综合管理部总经理、信托管理三部副总经理。现任广东粤财信托有限公司总经理助理、信托管理三部总经理。

刘朝先生，经济学硕士，董事。曾任湖南证券发行部经理助理，湘财证券投行部总经理助理，财富证券投资银行总部副总经理，五矿二十三冶建设集团副总经理、党委委员。现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、资本运营部部长，兼任佛山国星光电股份有限公司董事，深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事，新晟期货有限公司董事。

王化成先生，经济学博士，独立董事。曾任中国人民大学商学院副教授、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。

何小锋先生，经济学博士，独立董事。曾任广东省韶关市教育局干部，中共广东省委韶关市委宣传干部，北京大学经济学院讲师、副教授、金融系主任。现任北京大学经济学院教授、博士生导师。

朱征夫先生，法学博士，独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所律师金融房地产部主任，广东大陆律师事务所合伙人，广东省国土厅地产产规划部服务中心副主任。现任广东方昆仑律师事务所主任。

陈晖先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南营业部经理，广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李勤金先生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记，中国证监会广州证监局处长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理，广州市广永国有资产经营有限公司董事长，万联证券股份有限公司董事长，广州银行副董事长，广州股权交易中心有限公司董事长，立根融资租赁有限公司董事长，广州立根小额贷款股份有限公司董事长。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管，易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理。现任易方达基金管理有限公司互联网金融部总经理。

张佑先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理，广东证券公司发行上市部经理，深圳证券交易所基金部总经理，易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁，易方达资产管理（香港）有限公司董事。

曾坚先生，经济学硕士，副总裁。曾任广东粤财信托投资公司职员，香港安财投资有限公司财务部经理，粤信(香港)投资有限公司业务部副经理，广东粤财信托投资公司基金部经理，易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、总裁助理、专户投资总监、专户首席投资官；基金科翔基金经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理、投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁，易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营销部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、基金总部研究部行业研究员，易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理，市场部华东区大区销售助理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券股份有限公司营业部职员，深圳东方大投资有限公司基金部副总经理，广发证券有限责任公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益部总

经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官；基金科讯基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益部总经理、现金管理部总经理，易方达资产管理（香港）有限公司董事、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人（RO）、就证券提供意见负责人（RO）、提供资产管理负责人（RO）。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长，易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品执行官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员，深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理，深圳证券交易所北京中心助理主任，上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品执行官，易方达资产管理（香港）有限公司董事。

2. 基金经理

胡剑先生，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金固定收益助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)基金经理（自2012年11月8日至2014年3月28日）、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2013年7月30日至2015年3月13日）、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2013年4月22日至2015年3月13日）。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理（自2012年2月29日起任职）、易方达信用债惠回报定期开放式证券投资基金（自2013年4月24日起任职）、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理（自2013年12月17日起任职）。

张雅君女士，经济学硕士。曾任海通证券股份有限公司任项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理（自2014年7月19日起任职）、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理（自2015年1月10日起任职）、易方达纯债惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金基金经理助理。

李一硕先生，经济学硕士。曾任瑞银证券有限公司研究员、中国国际金融有限公司研究员、易方达基金管理有限公司研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2014年7月12日起任职）、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2015年3月14日起任职）、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金基金经理助理、易方达信用债惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理。

叶健女士，工学硕士。曾任易方达基金管理有限公司研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、易方达信用债惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理。

苏宁先生，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司交易员、研究员。现任易方达基金管理有限公司易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、易方达信用债惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理助理。

3. 投资决策委员会成员
本公司固定收益投资决策委员会成员包括：马骏先生、袁方女士、王曉晨女士、胡剑先生、张清华先生。

马骏先生，同上。
袁方女士，工学硕士。曾任中慧会计师事务所审计师、资产评估师，湘财证券有限责任公司投资经理，泰来人寿保险(中国)投资有限公司，弘弘基金管理有限公司基金经理、固定收益总监，泰康资产管理有限责任公司年金投资部高级投资经理、执行总监，易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理助理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理助理。

王曉晨女士，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金货币市场基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理助理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

胡剑先生，同上。
张清华先生，物理学硕士。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师、中信证券股份有限公司研究员、易方达基金管理有限公司投资经理。现任易方达基金管理有限公司易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理。

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路154号
办公地址：广州市天河区珠江新城兴业大厦20楼（资产托管部办公地址）
法定代表人：高建平
注册日期：1988年8月26日
注册资本：190.52亿元人民币
托管部丁联系人：张杰永
电话：(021) 62677777/212004
传真：(021) 62159217

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1.直销机构：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中三路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：叶俊英
电话：020-85102506
传真：4008818099
联系人：温海萍
网址：www.efunds.com.cn
直销机构网点信息：
(1) 易方达基金管理有限公司广州直销中心
地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40F
邮政编码：510620
传真：400-881-8099
电话：020-85102506
(2) 易方达基金管理有限公司北京直销中心
地址：北京市西城区金融大街20号B座8层
邮政编码：100033
传真：400-881-8099
电话：010-63213377
(3) 易方达基金管理有限公司上海直销中心
地址：上海市世纪大道88号金茂大厦2706-2708室
邮政编码：200121
传真：400-881-8099
电话：021-50476668
(4) 易方达基金管理有限公司网上交易系统
网址：www.efunds.com.cn
客户服务电话：020-38798812
客户服务电话：400-881-8098

2.非直销销售机构

兴业银行股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路154号中山大厦
办公地址：福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人：高建平
联系人：曾鸣
联系电话：021-52629999
客户服务电话：95561
网址：www.cib.com.cn
(二) 基金登记机构
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中三路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：叶俊英
电话：4008818088
传真：4008818099
联系人：余嘉富
(三) 律师事务所和经办律师
律师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
主要办公场所：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
执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：010-58153030
传真：010-58188298
经办注册会计师：昌华、熊姝英

联系人：许建辉

四、基金的名称

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款和银行存单等固定收益类资产、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种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，但须符合中国证监会相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产不低于基金资产净值的70%；对权益类资产的投资不超过基金资产净值的30%（以上两处比例限制在开放运作期开始后的第一个自然日至开放运作期结束后15个自然日内不受此比例限制），在开放运作期内，资金及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%。

八、基金的投资策略

本基金在封闭运作期与开放运作期采取不同的投资策略。

（一）封闭运作期策略

1. 资产配置策略
本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考虑各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票资产和固定收益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。

2. 固定收益类资产投资策略
（1）债券投资策略
本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。

①在久期配置方面，本基金将对宏观经济走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策动向等进行研究，预测未来收益率曲线变动趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总体投资收益。

②在类属配置方面，本基金将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化、以及信用债券的信用风险等因素进行分析，根据债券类属的风险收益特征，定期对债券类属资产进行优化配置和调整，确定债券类属资产的最优权重。

③在期限结构配置方面，本基金将对市场收益率曲线变动情况进行研判，在长期、中期和短期债券之间进行配置，适时采用子弹型、哑铃型或梯型策略构建债券组合，以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。

④在个券选择方面，对于国债、央行票据等非信用类债券，本基金将根据宏观经济增长和宏观经济政策的影响，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑流动性及信用风险等因素，对个券进行投资。本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资价值的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

（2）银行存款和银行存单投资策略
对于银行存款及大额存单的投资，本基金根据宏观经济指标分析债券类资产和银行存款的预期收益率水平，制定和调整银行存款及大额存单投资比例、存款期限结构。

（3）杠杆投资策略
本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，通过债券回购等杠杆操作放大组合收益。

（4）可转换债券投资策略
可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金管理人将对可转换债券价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购。

3. 股票投资策略
本基金将严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金股票投资的主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业发展空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，在严格控制风险的基础上进行股票投资。

4. 其他投资策略
在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将投资股票期权、股票指数期权、场外衍生品工具等金融品种，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

（二）开放运作期策略
开放运作期内，本基金为方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制及投资组合的前提下，将增加高流动性投资品种的投资比例，以降低基金净值波动。

九、基金的业绩比较基准

同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率（税后）+1.75%

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告（未经审计）

本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。
本基金的投资组合报告前一日基金资产净值如下表所示：

本报告投资组合有关数据的期间为2014年10月1日至2014年12月31日。

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	174,782,574.52	4.85
	其中：股票	174,782,574.52	4.85
2	固定收益投资	3,261,029,848.83	90.40
	其中：债券	3,261,029,848.83	90.40
3	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
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	92,648,356.48	2.57
7	其他资产	78,820,643.73	2.19
8	合计	3,607,281,423.56	100.00

2. 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	12,546,914.04	0.52
C	制造业	13,839,180.02	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,294,489.17	0.84
E	建筑业	4,740,000.00	0.20
F	批发和零售业	5,513,215.40	0.23
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	4,010,000.00	0.17
J	金融业	113,838,775.89	4.72
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	国民服务、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		174,782,574.52	7.25

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	002736	国信证券	9,436,346	95,873,275.36	3.98
2	600795	国电电力	4,383,259	20,294,489.17	0.84
3	600109	国金证券	907,807	17,965,500.53	0.75
4	601969	南矿矿业	787,628	12,546,914.04	0.52
5	002271	东方雨虹	189,777	6,333,833.18	0.26
6	603368	柳药医药	107,261	5,513,215.40	0.23
7	002375	亚厦股份	250,000	4,740,000.00	0.20
8	002063	远光软件	200,000	4,010,000.00	0.17
9	600887	伊泰股份	100,000	2,863,000.00	0.12
10	600481	双良节能	200,000	2,018,000.00	0.08

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	92,648,356.48		2.57
7	其他资产	78,820,643.73		2.19
8	合计	1,000,000,000.00		28.33

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	110,117,000.00	4.57
	其中：政策性金融债	110,117,000.00	4.57
4	企业债券	2,816,823,158.55	116.82
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	203,455,000.00	8.44
7	可转债	130,634,690.28	5.42
8	其他	—	—
9	合计	3,261,029,848.83	135.24

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	110018	国债转债	343,090	70,728,003.50	2.93
2	122589	12国债	599,890	6,330,381.80	2.63
3	124004	12国债	590,010	59,591,010.00	2.47
4	124048	12国债	570,000	58,254,000.00	2.42
5	124483	09国债	550,000	58,135,000.00	2.41

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。