

信息披露 Disclosure

(上接B232版)

网址:www.hjqz.com.cn
(91) 金元证券
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆清
联系人:马贤清
联系电话:0755-83025022
客户服务电话:400-8888-228
传真:0755-83025625
网址:www.jyzq.cn
(92) 开源证券
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
联系人:付琦
联系电话:029-81887063
客户服务电话:400-860-8866
传真:029-88447611
网址: www.kysecn.cn
(93) 民族证券
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盈大观A座F40-43
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盈大观A座F40-43
法定代表人:赵大建
联系人:李微
客户服务电话:400-889-5618
网址: www.e5618.com
(94) 南京证券
注册地址:江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人:步国旬
联系人:孙秀玉
联系电话:025-83367888-4107
客户服务电话:400-828-5888
传真:025-83320066
网址:www.njqzq.com.cn
(95) 平安证券
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:谢永林
联系人:吴琼
客户服务电话:95511-8
开放式基金业务传真:0755-82400862
网址: www.pingan.com
(96) 齐鲁证券
注册地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
联系电话:0531-68889155
客户服务电话:95538
传真:0531-68889185
网址: www.qlzq.com.cn
(97) 日信证券
注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈文彬
联系电话:010-83991716
客户服务电话:400-660-9839
传真:010-66412537
网址:www.rxzq.com.cn
(98) 瑞银证券
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
办公地址: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
联系人:冯爽
联系电话:010-58328373
客户服务电话:400-887-8827
传真:010-58328170
网址: www.ubssecurities.com
(99) 山西证券
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭烟
联系电话:0351-86866699
客户服务电话:95573或400-666-1618
传真:0351-86866199
网址: www.i618.com.cn
(100) 上海证券
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
联系人:张瑾
联系电话:021-53519888
客户服务电话:021-962518
传真:021-65081069
网址: www.962518.com
(101) 申万宏源证券
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:曹晔
联系电话:021-33389888
客户服务电话:95523,4008895523
传真:021-33388224
网址: www.swjhsc.com
(102) 申万宏源西部证券
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际20楼2005室
法定代表人:许建平
联系人:李巍
联系电话:010-88095858
客户服务电话:400-800-0562
传真:010-88085195
网址: www.hysec.com
(103) 世纪证券
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层
法定代表人:姜昧军
联系人:雷新东
联系电话:0755-83199511
开放式基金咨询电话:0755-83199511
开放式基金业务传真:0755-83199545
网址: www.csco.com.cn
(104) 天源证券
注册地址:西宁市城中区西大街11号
法定代表人:刘盛
联系人:张帆雅
联系电话:0755-33331188-8807
客户服务电话:4006543218
传真:0755-33329815
网址: www.tyzq.com.cn
(105) 天风证券
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

办公楼地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87618957
传真:027-87618863
客户服务电话:4008005000
公司网站: http://www.tfzq.com/
(106) 万联证券
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:王鑫
联系电话:020-38286651
客户服务电话: 400-8888-133
开放式基金业务传真:020-22373718-1013
网址: www.wlzq.com.cn
(107) 西部证券
注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
联系人:刘莹
联系电话:029-87406649
客户服务电话:029-95582
传真:029-87406710
网址: www.westsecu.com.cn
(108) 西南证券
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
联系电话:023-63786633
客户服务电话:4008096096
传真:023-63786212
网址: www.swsc.com.cn
(109) 湘财证券
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人:林俊波
联系人:赵小明
联系电话:021-69634510-8620
开放式基金咨询电话:400-888-1551
开放式基金业务传真:021-68865680
网址: www.xcsc.com
(110) 新时代证券
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层
法定代表人:刘汝军
联系人:孙恺
联系电话:010-83561149
客户服务电话:400-698-9898
开放式基金业务传真:010-83561094
网址: www.xsdzq.cn
(111) 信达证券
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
客户服务电话:400-800-8899
传真:010-63080978
网址: www.cindasc.com
(112) 兴业证券
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层
法定代表人:兰荣
联系人:夏中苏
联系电话:0591-38281963
客户服务电话:95562
网址: www.xyzq.com.cn
(113) 银河证券
注册地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层
法定代表人:陈立

联系人:戴蕾
联系电话:0791-86768681
客户服务电话:400-8866-567
传真:0791-86770178
网址: www.avicsec.com
(114) 中金公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼27层及28层
法定代表人:丁学东
联系人:杨涵宇
联系电话:010-65051166
网址: www.cicc.com.cn
(117) 中山证券
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
法定代表人:吴永良
联系人:罗艺琳
客户服务电话:4001022011
网址: www.zszq.com.cn
(118) 浙商证券
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座7层
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7层
法定代表人:吴承根
联系人:陆云
联系电话:021-64318677
客户服务电话:0571967777
传真:021-64713759
网址: www.stocke.com.cn
(119) 中天证券
注册地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马力功
联系人:王力华
电话:024-23280810
传真:024-23280834
客户服务电话:4006180315
公司网站: http://www.stockren.com/
(120) 中投证券
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18-21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:龙增来
联系人:刘毅
联系电话:0755-82023442
客户服务电话:400-600-8008、95532
传真:0755-82026539
网址: www.china-invs.cn
(121) 中信建投证券
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
开放基金咨询电话:95587
开放式基金业务传真:010-65182261
网址: www.cs108.com
(122) 中信证券
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)
北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:顾凌
联系电话:010-60838696
传真:010-60833739
网址: www.cs.ecitic.com
(123) 中信证券(浙江)
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人:沈强
联系人:李珊
联系电话:0571-85776114
客户服务电话:95548
传真:0571-85783771
网址: www.bigsun.com.cn
(124) 中信证券(山东)
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
(260601)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
联系电话:0532-85022326
客户服务电话:95548
传真:0532-85022605
网址: www.cticsd.com
(125) 中银国际证券
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人:许刚
联系人:王炳哲
开放基金咨询电话:400-620-8888
开放式基金业务传真:021-50372474
网址: www.bocichina.com
(126) 中原证券
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
联系人:程伟伟
客户服务电话:95548
联系人:范春艳
联系电话:0371-6909882
客户服务电话:0371-967218、4008139666
网址: www.ccnew.com
(127) 创金启富
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁蓉
联系人:张晶晶
电话:010-66154828-809
传真:010-88067526
客户服务电话:010-66154828
公司网站: www.5irich.com
(128) 泛华普益
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:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海锋
联系人:邓鹏
联系电话:028-82000996-828
客户服务电话:4008588588
传真:028-82000996-805
公司网址: www.pyfund.cn
(129) 海银基金管理
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
法定代表人:刘惠
联系人:刘艳娟
客户服务电话:400-920-0022
公司网站: http://licaike.hexun.com/
(130) 和讯信息
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址: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:于扬
电话:021-20835779
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
公司网站: http://licaike.hexun.com/
(131) 和讯信息
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址: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:于扬
电话:021-20835779
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
公司网站: http://licaike.hexun.com/
(132) 恒天明泽
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中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:周斌
联系人:马鹏程
电话:010-57756074
传真:010-56810789
客户服务电话:400-786-8868-5
公司网站: www.chtfund.com
(133) 金观诚
注册地址:浙江杭州西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)801室
办公地址:杭州拱墅区登云路43号金诚集团(锦昌大厦)
法定代表人:陈彬彬
联系人:邓秀勇
电话:0571-88337734
传真:0571-88337968
客户服务电话:4000680058
公司网站: http://www.jincheng-fund.com/
(134) 久富财富
注册地址:上海市浦东新区莱阳路2819号1幢109室
办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人:赵惠蓉
联系人:徐金华
电话:021-68685825
传真:021-68682297
客户服务电话:400-021-9898
公司网站: www.jftct.com
(135) 宜投基金管理
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室
办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405室
法定代表人:王清照
联系人:刘勇
电话:0755-88607645
传真:0755-88603185
客户服务电话:4008-955-811
公司网站: www.ucffund.com
(136) 钱景财富
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012室
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012室
法定代表人:赵春荣
联系人:魏静
电话:010-57418829
传真:010-57569671
客户服务电话:400-678-5095
公司网站: www.niuji.net
(137) 诺亚正行
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38600735
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399

法定代表人：蒋煜
联系人：徐长征、崔乐乐
电话:01058170943,01058170949
传真:01058170800
客户服务电话:4008188866
公司网站:www.shengshiview.com
(141) 数米基金
注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张锐
联系电话:021-60897840
客户服务电话:4000-766-123
传真:0571-26697013
网址:<http://www.fund123.cn/>
(142) 天天基金
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
联系电话:021-54509998
客户服务电话:400-1818-188
传真:021-64385308
网址:www.1234567.com.cn
(143) 同花顺
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦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2
法定代表人:凌顺平
联系人:胡璇
联系电话:0571-88911818
客户服务电话:0571-88920897,4008-773-772
传真:0571-88910240
网址:www.5ifund.com
(144) 万银财富
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院盛古观3201
法定代表人:王斐
联系人:廉亮
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客服电话:400-081-6655
公司网站:<http://www.wy-fund.com/>
(145) 一路财富
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:段京璐
电话:010-88312877
传真:010-88312099
客户服务电话:400-001-1566
公司网站:www.yilucaifu.com
(146) 宜信普泽
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟桦
联系人:程刚
电话:010-52855713
传真:010-85894285
客户服务电话:400-6099-200
公司网站:www.yixinfund.com
(147) 展恒基金
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞
联系电话:010-62020088
客户服务电话:400-888-6661
传真:010-62020355
网址:www.myfund.com
(148) 增财基金
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗湘安
联系人:史丽丽
电话:010-67000988
传真:010-67000988-6000
客户服务电话:400-001-8811
公司网站:www.zcvc.com.cn
(149) 中国国际期货
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11
12层
法定代表人:王兵
联系人:孟夏
电话:010-59539861
传真:010-59539806
客户服务电话:95162
公司网站:<http://www.cifco.net/>
(150) 中期资本
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人:路耀
联系人:侯英建
电话:010-65807865
传真:010-65807864
客户服务电话:010-65087609
公司网站:www.cifcofund.com
(151) 众禄基金
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层J单元
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客户服务电话:4006-788-887
公司网站:www.zlfund.cn www.jimmw.com
(二) 基金注册登记机构
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
43楼
法定代表人:叶俊英
电话:040 881 8088
传真:020-38799249
联系人:余贤高
(三) 律师事务所和经办律师
律师事务所:北京市天元律师事务所
地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人:王立华
电话:010-88092188
传真:010-88092150
经办律师:朱小辉、陈华
联系人:王立华
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
传真电话:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:薛竟、沈兆杰
四、基金的名称
本基金名称:易方达稳健收益债券型证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型:债券型基金
六、基金的投资目标
通过主要投资于债券品种,追求基金资产的长期稳健增值。
七、基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融
券、央行票据、企业债,可转换债券(含可分离型可转换债券)、资产支持
券、债券回购等固定收益品种,银行存款、股票,以及法律法规或中国证
券会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基
金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资
范围。
本基金各类资产的投资比例为:债券等固定收益品种不低于基金资
产的80%,其中,可转换债券不高于基金资产的30%;股票等权益类品种
不高于基金资产的20%;基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内
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
1. 资产配置策略
本基金基于以下因素的判断,进行基金资产在固定收益品种、可转
债券、股票主动投资以及新股(含增发)申购之间的配置:1、主要基于
利率走势、利率期限结构等因素的分析,预测固定收益品种的投资收
益和风险;2、基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等,预测新
申购的收益率以及风险;3、股票市场走势的预测;4、可转换债券发行
公司的成长性和转债价值的判断。
2. 固定收益品种投资策略
(1) 固定收益品种的配置策略
a. 平均久期配置
本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信
息、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数、汇率等)和宏观
经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外债和汇率政策等)进行
分析,预测未来的利率趋势,判断债券市场对上述变量和政策的反应,并
以此调整债券组合的平均久期,提高债券组合的总投资收益。
b. 期限结构配置
本基金对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析
方法,预测收益率期限结构的变化方式,选择确定期限结构配置策略,配
各期限固定收益品种的比例,以达到预期投资收益最大化的目的。
c. 类属配置
本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动
性、市场风险等因素进行分析,研究不同期限的国债、金融债、企业债以及交
易和银行间市场品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策
略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。
d. 信用类债券投资
本基金投资于信用状况良好的信用类债券。在此基础上,分析各品
种的信用溢价,择选信用风险较低和溢价较高的品种进行投资。
(2) 投资品种的选择
在债券组合平均久期、期限结构、类属配置和信用风险管理的基础
上,本基金将根据个别债券定价的主要因素,包括流动性、局部供求、信用
风险、票息、税赋、含权等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品
种进行投资。
(3) 可转换债券的投资策略
可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债价价值和转换期权价
值。本基金管理人将对可转换债券的价值进行评估,选择具有较高投资
价值的可转换债券进行投资。
基金管理人将对发行公司的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、
成长性、市场竞争能力等,并参考同类公司的估值水平,判断可转换债
券的股权投资价值;基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因
素的分析,判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转换债券的
转换期权价值;综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换
债券的股权投资策略。
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
极参与可转换债券的新申购。为控制基金的波动性和流动性风险,本基金
可参与转换债券的资产不超过基金资产的30%。
(4) 资产支持证券投资
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比

报告期末基金资产组合情况						
项目		金额(元)	占基金总资产的比例(%)			
权益投资		235,426,455.53	9.69			
其中：股票		235,426,455.53	9.69			
固定收益投资		2,005,210,036.57	82.55			
其中：债券		2,005,210,036.57	82.55			
资产支持证券		—	—			
贵金属投资		—	—			
金融衍生品投资		—	—			
买入返售金融资产		59,400,209.10	2.45			
其中：买断式回购的买入返售金融资产		—	—			
银行存款和结算备付金合计		53,031,266.96	2.18			
其他资产		76,145,116.01	3.13			
合计		2,429,213,084.17	100.00			
报告期末按行业分类的股票投资组合						
行业类别		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)			
农、林、牧、渔业		—	—			
采矿业		—	—			
制造业		141,042,051.51	7.13			
电力、热力、燃气及水生产和供应业		15,826,209.05	0.80			
建筑业		26,348,787.84	1.33			
批发和零售业		9,539,217.85	0.48			
交通运输、仓储和邮政业		—	—			
住宿和餐饮业		—	—			
信息传输、软件和信息技术服务业		10,023,457.24	0.51			
金融业		21,56,327.44	1.10			
房地产业		8,720,000.00	0.44			
租赁和商务服务业		—	—			
科学研究和技术服务业		—	—			
水利、环境和公共设施管理业		—	—			
居民服务、修理和其他服务业		—	—			
教育		—	—			
卫生和社会工作		2,270,413.60	0.11			
文化、体育和娱乐业		—	—			
综合		—	—			
合计		235,426,455.53	11.90			
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						
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(%)	
000623	吉林敖东	911,135	31,715,913.15	1.60		
002375	亚厦股份	1,389,704	26,348,787.84	1.33		
600143	金发科技	1,884,865	12,986,740.52	0.66		
601139	深赛燃气	1,299,908	10,724,241.00	0.54		
000729	燕京啤酒	1,247,395	9,966,686.05	0.50		
002390	信邦制药	471,815	9,540,099.30	0.48		
601989	中航重机	1,002,953	9,237,197.13	0.47		
000651	格力电器	242,037	8,984,413.44	0.45		
600340	华夏幸福	200,000	8,720,000.00	0.44		
002035	华帝股份	716,266	8,638,167.96	0.44		
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(%)		
	国家债券	—	—	—		
	央行票据	—	—	—		
	金融债券	100,192,000.00	5.07			
	其中：政策性金融债	100,192,000.00	5.07			
	企业债券	1,315,490,788.34	66.52			
	企业短期融资券	—	—			
	中期票据	312,547,000.00	15.80			
	可转债	276,980,248.23	14.01			
	其他	—	—			
	合计	2,005,210,036.57	101.40			
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						
序号	债券品种		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
	国家债券	—	—	—		
	央行票据	—	—	—		
	金融债券	100,192,000.00	5.07			
	其中：政策性金融债	100,192,000.00	5.07			
	企业债券	1,315,490,788.34	66.52			
	企业短期融资券	—	—			
	中期票据	312,547,000.00	15.80			
	可转债	276,980,248.23	14.01			
	其他	—	—			
	合计	2,005,210,036.57	101.40			
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						
序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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						
序号	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
	本基金报告期末未持有资产支持证券。					
	本基金报告期末未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					
	本基金报告期末未持有贵金属。					
	本基金报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证					
	本基金报告期末未持有权证。					
	本基金报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货交易情况说明					
	本基金报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货交易情况说明					
	本基金报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证					
	本基金报告期末未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。					
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						
序号	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
	本基金报告期末未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					
	本基金报告期末未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					
	本基金报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证					
	本基金报告期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证					
其他资产构成						
序号	名称		金额(元)			
	存出保证金		156,264.17			
	应收证券清算款		15,830,405.06			
	应收股利		—			
	应收利息		39,937,997.76			
	应收申购款		20,217,464.82			
	其他应收款		2,984.20			
	待摊费用		—			
	其他		—			
	合计		76,145,116.01			
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	113005	平安转债	659,130	118,920,234.60	6.01	
2	101453022	14五矿债	800,000	81,024,000.00	4.10	
3	110018	国电转债	257,100	53,001,165.00	2.68	
4	124580	14海普	400,000	43,956,000.00	2.22	
5	124247	13临商	400,000	42,200,000.00	2.13	
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	数量(份)	公允价值(元)	占基金	