

(上接B021版)

(118)华福证券有限责任公司	
住所、办公地址	福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址	福州市五四路157号新天地大厦7层10层
法定代表人	张金琳
联系人	张金琳
电话	(0591) 187383623
传真	(0591) 187383610
网址	www.hfzq.com.cn
(119)华龙证券有限责任公司	
住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心
法定代表人	李敬安
联系人	李新田
电话	(0931) 4880026
传真	(0931) 4880028
网址	www.hlzq.com.cn

(120)中国国际金融有限公司	
住所	北京建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层
办公地址	北京建国门外大街1号国贸大厦2层28层
法定代表人	李国卿
联系人	陈欣
电话	(010) 16601166
传真	(010) 16601166
网址	www.cicc.com.cn

(121)财通证券有限责任公司	
住所、办公地址	杭州市大新路16号富阳国际商务中心
法定代表人	陈伟新
联系人	余勇
电话	(0571) 187926129
传真	(0571) 87918329
网址	www.ctsec.com

(122)上海华信证券有限公司	
注册地	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9层
法定代表人	罗海
电话	021-38794817
传真	021-68776678
网址	www.huaxinsec.com

(123)华鑫证券有限责任公司	
住所、办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦20层A1、A01、1单元
法定代表人	陈野
联系人	孔琳
电话	(0755) 16283798
传真	(0755) 16283408
网址	www.cfsc.com.cn

(124)瑞银证券有限责任公司	
住所、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	程实
联系人	李坤
电话	010 138208112
传真	010165832848
网址	www.ubssecurities.com

(125)中国中投证券有限责任公司	
住所	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心A座18层、21层及40层A101、02、03、06、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、25、29层
办公地址	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心A座18层、21层及40层A101、02、03、06、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、25、29层
法定代表人	龙长荣
联系人	陈永
电话	0755-82263442
传真	0755-82262839
网址	www.citics.com

(126)中山证券有限责任公司	
住所、办公地址	深圳市福田区益田路4018号平安金融中心A座20层
法定代表人	李永
联系人	李坤
电话	(0755) 16283798
传真	(0755) 16283408
网址	www.zszq.com.cn

(127)国信证券股份有限公司	
住所、办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人	李松
联系人	李坤
电话	(0755) 16283798
传真	(0755) 16283408
网址	www.guosen.com.cn

(128)江海证券有限公司	
住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区公路大桥南111号
法定代表人	李峰
联系人	李坤
电话	0451-8383719
传真	0451-8383711
网址	www.jhsec.com.cn

(129)国金证券股份有限公司	
住所、办公地址	四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人	冉净
联系人	李坤
电话	(028) 199990128
传真	(028) 199990128
网址	www.guojin.com.cn

(130)中国民族证券有限责任公司	
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路28号嘉泰大厦B座10层
法定代表人	李微
联系人	李坤
电话	(010) 166536941
传真	(010) 16653691
网址	www.mzsec.com.cn

(131)华证证券有限责任公司	
住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人	陈林
联系人	倪元
电话	(021) 16877722
传真	(021) 16877822
网址	www.zhsstock.com

(132)长城国瑞证券有限公司	
住所、办公地址	广州市天河区二沙岛东苑十七楼
法定代表人	王勇
联系人	卢文义
电话	(0662) 15161462
传真	(0662) 15161140
网址	www.w6116.com

(133)爱建证券有限责任公司	
住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号32楼
法定代表人	陈敏
联系人	陈敏
电话	(021) 12222888
传真	(021) 68726792
网址	www.ajzq.com

(134)英大证券有限责任公司	
住所	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
注册地	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	张强
联系人	莫尔东
电话	0755-83007159
传真	0755-83007094
网址	www.ydsec.com.cn

(135)华融证券股份有限公司	
住所	北京市西城区金融大街9号
办公地址	北京市西城区金融大街9号新融国际大厦3层
法定代表人	宋广文
联系人	陈欣
电话	010-58568235
传真	010-58568062
网址	www.huarongsec.com

(136)天风证券股份有限公司	
住所	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
注册地	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	杨斌
电话	027-87610052
传真	027-87611893
网址	www.tfzq.com

信达证券股份有限公司	
住所	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心18层
注册地	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心18层
法定代表人	达玉明
联系人	刘亚明
电话	028-16190278
传真	028-16190382
网址	www.cindasc.com

(二) 注册登记机构	
嘉实基金管理有限公司(同上)	
(二) 律师事务所和经办律师	
名称	国浩律师集团(上海)事务所
住所、办公地址	北京市东城区东直门北大街3号泰康国际大厦B座09层
负责人	王卫东
联系人	肖世明
电话	(010) 16580661
传真	(010) 165176801
经办律师	黄国良

(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	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	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人	李伟
联系人	李坤
电话	(021) 12222888
传真	(021) 12222880

七、基金的投资目标	
本基金通过控制投资组合的久期不超过一年,力求本金稳妥,保持资产较高的流动性,降低基金净值波动风险,取得超过比较基准的稳定回报。	

八、基金的投资策略	
本基金投资范围为固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

九、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十一、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十二、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十三、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十四、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十五、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十六、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十七、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十八、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

十九、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十一、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十二、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十三、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十四、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十五、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十六、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十七、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十八、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

二十九、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十一、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十二、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十三、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十四、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十五、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十六、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

三十七、基金的投资限制	
本基金投资范围固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级以上(含)的企业债及次级债等;债券回购;央行票据;银行存款;资产支持证券以及法律法规、证监会和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于可转换债券。	

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	固定收益投资	967,428,301.54	91.85
其中:债券	966,428,301.54	90.80	
3	资产支持证券	11,000,000.00	1.04
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	58,060,634.28	5.51
7	其他资产	27,323,703.79	2.61
合计	1,053,312,644.76	100.00	

报告期末按行业分类的股票投资组合	
本基金本报告期末未持有股票。	
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	
本基金本报告期末未持有股票。	
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	
本基金本报告期末未持有债券。	

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	60,180,000.00	7.77
其中:政策性金融债	60,180,000.00	7.77	
4	企业债	203,930,301.54	31.56
5	企业短期融资券	462,415,000.00	71.67
6	中期票据	239,703,000.00	37.13
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
合计	966,428,301.54	148.17	

3	金融债券	50,180,000.00	7.77
	其中:政策性金融债	50,180,000.00	7.77
4	企业债券	203,930,301.54	31.59
5	企业短期融资券	462,615,000.00	71.67
6	中期票据	239,703,000.00	37.13
— 资产总计			