

鹏华实业债纯债债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

1000强排名全球，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名位列第2；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12位。	20层	办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州国际金融中心主塔19层、20层	20层	法定代表人：邱二波 联系人：林洁茹 联系电话：020-88836399 传真号码：020-88836654 客服热线：021-961303	五、基金的操作方式与类型	契约型开放式，债券型证券投资基金。	六、基金的投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以实业债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。	七、基金的投资方向	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融
---	------------	---	------------	--	---------------------	--------------------------	------------------	---	------------------	---

[illegible]

并负责工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。 张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行,中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行政办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。 张力冲,投资托管业务部副经理,曾就职于中国建设银行总行经济金融部、信贷一部、信贷部、信贷管理,信贷经营,并在总行经营总部和资产与风险管理部从事管理工作,具有多年的资产管理、风险控制从业经验。	联系人:钟银霞 客户服务电话:400-888-1151 网址:www.xscc.com (12)光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区新闸路1508号 办公地址:上海市静安区新闸路1508号	基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%;对实业类的投资比例不超过固定收益类资产的30%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。 本基金所指实业类是指实体经济领域的实业类产业的投资,包括这类企业所发行的公司债、企业债、中期票据、短期融资券等。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资限制,基金管理人将在履行
--	--	---

基金合同及 为基金提供 法律服务的 律师事务所	具有多年的客户服务和业务管理经验。 黄秀德, 投资托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行会计部, 长期从事托管业务管理等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。 (三) 基金托管业务经营情况 作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行, 中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念, 不断加强风险管理和内部控制, 严格履行托管人	电话: 021-22196081 传真: 021-68817271 联系人: 刘晨 客服电话: 95525 公司网站: www.ebscn.com (13) 华南证券股份有限公司 地址: 广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 楼 01 单元 邮编: 518048 电话: 0755-83734353 传真: 0755-83734354 联系人: 陈静	适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。 八、基金的投资策略 (一) 投资策略 在资产配置策略 在资产配置方面, 本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线
---	---	---	--

的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断丰富,已形成包括证券投资基金、企业年金基金、基本养老保险个人账户、QDII、企业年金等在内的国际托管业务体系,是目前国内资产规模最大的商业银行之一。截至2014年12月末,中国建设银行共托管389只证券投资基金,中国建设银行资产高效的托管服务能力屡获业内高度评价。中国建设银行自2009年以来连续五年被国际权威机构《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。	注册地址:深圳市福田区金田路4188号中国建设大厦2层A01、B01(1)单元 办公地址:上海市浦东新区金田路750号 法定代表人:王洪章 联系人:陈颖 联系电话:021-64666000 传真:021-64666802 客户服务热线:021-32109999-020-68918888-4001099918
--	---

获和讯网的“中国”最佳资产管理银行奖；境内权威经济媒体《每日经济新闻》的“最佳财富管理银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司颁发的“优秀托管机构”奖。 三、相关服务机构 (一) 基金份额销售机构 1. 直销机构 (1) 鹏华基金管理有限公司直销中心	网址: www.psfund.com (14) 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4楼 办公地址: 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: 崔媛
(二) 基金管理人委托的代销机构 1. 中国工商银行股份有限公司 注册地址: 北京市西城区复兴门内大街26号 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街26号 法定代表人: 姜建清 联系人: 王芳	本基金将主要采取久期策略, 同时辅之以信用策略, 收益率曲线策略, 收益率利差策略, 息差预期, 债券选择策略等积极投资策略, 在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上, 以实业债为主要投资标的, 力争取得超越基准业绩比较基准的收益。 (1) 久期策略 本基金将通过自上而下的组合久期管理策略, 以实现对组合利率风险的有效

办公地址：深圳市福田区福安社区维多利亞道18号万洲国际商务中心3层 电话：(0755) 62021893 传真：(0755) 62021165 联系人：吕奇志	电话：(027-87610062 传真：(027-87610863 客户服务热线：4000050000 网址：http://www.ttzq.com	控制。基金管理人将根据对宏观经济周期阶段以及宏观经济走势的判断并结合组合仓位，调整资产配置比例，以有效分散债券价格波动和利率上升带来的权益风险；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，以减少债券价格下降带来的风险。
(1) 鹏华基金管理有限公司北京分公司 办公地址：北京市西城区金融大街甲9号502室 电话：(010) 88082426 - 68	(15) 西部证券股份有限公司 注册地址：西安市东新街22号陕西信托大厦16-17楼 办公地址：西安市东新街22号陕西信托大厦6楼	(2) 信用策略 本基金通过主动判断适度的信用风险来获取超额收益。主要通过信用债收益率受信用利差变动趋势及信用估值变化而调整，相应地采用以下两种决策：

传真：(010) 88082018 联系人：李筠 (3) 鹏华基金管理有限公司上海分公司 办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗银行大厦80118室 电话：(021) 68876878 传真：(021) 68876821 联系人：李筠 (4) 鹏华基金管理有限公司深圳分公司 办公地址：深圳市福田区福华南路100号 电话：(0755) 23903800 传真：(0755) 23903801 联系人：李筠	法定代表人：刘建武 联系人：刘莹 电话：029-87406649 传真：029-87406710 客户服务电话：956682 网址：www.westsecu.com 客户邮箱：956682@westsecu.com	略： 1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。 2) 信用利用策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用评级相对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。	注 注 (
---	--	--	--

理与经	(4) 鹏华基金管理有限公司武汉分公司	(1) 深圳众禄基金销售有限公司	本基金将根据内、外部信用评级结果、债券类信用债信用评级历史以及
有限	办公地址：武汉市汉阳区建设大道568号新世界国贸A座11001室	注册地址：深圳市罗湖区梨园岭路裕安控股置地大厦41楼	对未来信用利差走势的判断，选择信用利差最高、使用信用利差可能下降的信用债
	联系电话：(027) 85557881	法定代表人：薛峰	进行投资。
改委委	传真：(027) 85557973	客服电话：4006-788-787	(3) 收益率曲线策略
副经	联系人：郑阳彤	传真：0755-82080738	收益率曲线的形状变化是判断市场整体利率变动的依据之一。本基金将根据此调整
经深	(5) 鹏华基金管理有限公司广州分公司	联系人：邓爱群	组合久期、中短期债的搭配。本基金将通过分析收益率曲线变化的预测，适时采用
			零成本、打穿或骑乘策略构造组合，进行主动久期调整。

地址：广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心24楼07单元 联系电话：(020) 38927993 传真：(020) 38927990	网址：www.zifund.cn, www.jinm.com.cn (2) 诺亚正行（上海）基金销售有限公司 办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室 法定代表人：汪静波 客服电话：400-021-5399 传真：021-39500707 联系人：何倩茜	(4) 诺奕策略 本基金将采用诺奕策略组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的多个期限区买入期限位于收益率曲线较陡峭处的债券。在收益率曲线不可变动的情况下，随着其剩余的期限的展期，债券收益将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步平坦，这一策略也能够提供更多的安全边际。	用。 (1) 本 法
---	---	---	--

信达证 券	办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 邮政编码：100033	网站：www.noah-fund.com (3) 杭州数米基金销售有限公司 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	(5) 息差策略 本基金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的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。	H
工银聚 信	法定代表人：王洪章 联系人：王亦菲	法定代表人：陈柏青 客服电话：4000-766-123 传真：0571-26698835	（6）债券选择策略 根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、期权特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。	H
裕盛资 本	客户服务电话：95633 网址：www.ydcn.com			个工 作日
总经 理				

发行人	(注)招商银行股份有限公司 注册(办公)地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦	联系人：王旭东 网址： www.cmbchina.com	承销商	中信证券股份有限公司 (住所)北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦	会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) (住所)上海市浦东新区东昌路160号
曾任						
郭德泰	电话：0755-81988888					
傅传真：0755-81950408						
郭国定	联系人：邓朝晖					
Investment	客户服务电话：95565					
安岳君						

网址: www.cmbchina.com (3) 交通银行股份有限公司 注册(办公)地址: 上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人: 李勇明 电话: 021-58781234 传真: 021-58408483	联系人: 林爽 网址: www.tsxsec.com (5) 上海长盛基金销售顾问有限公司 办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 法定代表人: 王燕 客服电话: 400-089-1299 网址: www.csfund.com	还本付息的公司债券。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况, 合理合规地投资中小企业私募债券。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用等级或发行人信用等级变化情况, 尽力规避可能存在的债券违约, 并获取超额收益。 本基金投资中小企业私募债券, 基金管理人将根据审慎原则, 制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案, 并经董事会批准, 以防范信用风险、流动性风险和多种风险。
--	---	---

联系人: 王人达 客户服务电话: 95569 网址: www.bankcomm.com (4) 北京银行股份有限公司 注册地址: 北京市西城区金融大街甲17号首层 办公地址: 北京市西城区金融大街甲17号 法定代表人: 闫冰竹	联系人: 刘娟 电话: 021-68789678-8201 传真: 021-68787696 客服电话: 400-089-1289 公司网站: www.sicichfund.com (6) 上海好买基金销售有限公司	(二) 投资决策依据及程序 1. 投资决策依据 (1) 有关法律、法规和基金合同的有关规定。 (2) 经济运行态势和证券市场走势。 (3) 投资对象的风险收益比。 2. 投资决策程序 (1) 投资决策委员会: 确定本基金总体资产配置和投资策略。 投资决策委员会
--	--	---

联系人: 谢小华 电话: 010-66223687 地址: 上海市浦东新区1118号鄂尔多斯大厦903-906室 住所: 上海市虹口区场中路685弄37/34号449室	定期召开会议,如需做出及时重大决策或基金经理提议,可临时召开投资决策委员会会议。 (2) 基金经理(或管理小组)设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的因素包括: 每日基金申购和赎回净现金流量; 基金合同的投资限制和比例限制; 研究员的投资建议; 基金经理的独立判断; 绩效与风险评估小组的建议等。
电话: 010-66226045 客户服务电话: 95528 网站: www.bankofchina.com (5) 中信银行股份有限公司 地址: 北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	法定代表人: 杨文斌 客服电话: 400-700-9665 传真: 021-50325589 联系人: 陶怡 网址: www.phowbo.com

利豪资产 法定代表人:常明 联系人:郭伟 客户服务电话:95568 网站: http://bank.ecitic.com (6) 上海浦东发展银行股份有限公司 注册(办公)地址:上海市中山东一路12号	(7) 北京展恒基金销售有限公司 办公地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 法定代表人:闫振杰 联系人:张晶晶 传真:(+86-10) 6202 0088 转8802 客服电话:400 888 6661	(3) 集中交易基金,基金投资向集中交易基金下投资指令,集中交易基金收到投资指令后分发给交易员,交易员收到基金投资指令后执行。 (4) 绩效与风险评估小组:对基金投资组合进行后评估,向基金经理(或管理小组)提出调整建议。 (5) 监察稽核部:对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。 (6) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境调整资产配置比例。
---	--	---

法定代理人: 吕晓峰 客户服务电话: 956283 联系人: 马强 公司网站: www.spdch.com.cn (7) 南京银行股份有限公司 住所: 江苏省南京市玄武区中山路288号 法定代理人: 林某	(8) 浙江同花顺基金销售有限公司 办公地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903 法定代表人: 李骁峰 客服电话: (0571) 66768888 传真: (0571) 89911818 联系人: 蒋萍君	九、基金的业绩比较基准 中债企业债总指数 × 80% + 中债国债总指数 × 20% 中债企业债总指数, 中债国债总指数是由中国国债及记账利率有限责任公司 (简称“中债公司”) 编制的, 分别反映企业债和国债市场整体价格和投资回报情况的指数。其中, 中债企业债总指数样本中包含在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有记账式国债; 中债企业债总指数样本中包含在银行间债券市场
---	--	--

客服电话:40088-96400 公司网址:www.njcb.com.cn (8) 吉林银行股份有限公司 注册地址:吉林省长春经济技术开发区东南湖大路1817号 法定代表人:唐国兴 客服电话:400-839-8666	网址:www.10jqka.com.cn (9) 上海天基金融销售有限公司 住所:上海市徐汇区龙阳路1910号2号楼2层 办公地址:上海市徐汇区龙阳路196号3C座10楼 法定代表人:蒋实 联系人:高莉莉 联系电话:021-60969777	场,广泛以上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债。该两个指数具有广泛的市場代表性,能够分别反映我国企业债、企业债市场的总体走势。 十、基金的风险收益特征 本基金属于债券型基金基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有中低风险收益特征的种类。 十一、基金的投资组合报告(未经审计)
---	--	--

网站: www.jlbank.com.cn (9) 中国邮政储蓄银行股份有限公司 注册地: 北京市西城区金融大街3号 办公地址: 北京市西城区金融大街3号 法定代表人: 李国华 客户服务热线: 95580	网站: www.1234567.com.cn 客服热线: 400181189 网站: www.1234567.com.cn (10) 浙江金观诚财富管理有限公司 住所: 拱墅区霞湾街239号9号楼403室 办公地址: 杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区8层 法定代表人: 陆彬彬	本基金托管人的重要会议及重大事项须经本托管人所派两名以上存任履职认真、诚实守信、勤勉尽责的董事或高级管理人员同意方可做出决议。 同时, 并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。 本基金的托管人中国建设银行履行中国证监会根据基金合同规定, 已于2015年4月16日复核了本报告书和摘要的内容, 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。 本报告中存在虚假记载数额仅限于2015年3月31日, 未超过1%。	基金资产
--	---	---	-------------

理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
金理事 注册地址：广东省东莞市南城区域路2号 法定代表人：何伟良 基金管理人：杨奇	（10）东莞农村商业银行股份有限公司 注册地址：广东省东莞市南城区域路2号 法定代表人：何伟良 基金管理人：杨奇	（11）和讯信息科技有限公司 住所：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	3 于新的 4 情况 基金文
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：鲁盛 联系电话：0571-56028617 客服电话：4000680058 网站：www.jinching-fund.com	1.报告期末基金资产组合情况
理人：杨雨 传真：(010) 68858117 公司网站：www.psbc.com	联系人：杨雨 传真：		

中国 有部副	客户服务热线:961122 网址: www.drcbank.com 3、券商代销机构 （1）中国银河证券股份有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	法定代表人：王莉 联系人：于扬 联系电话：021-20835888 客服电话：400-920-0022 网址：licaike.hexun.com	<table border="1"> <tbody> <tr> <td>2</td><td>固定收益投资</td><td>72,824,065.46</td><td>90.44</td></tr> <tr> <td></td><td>其中：债券</td><td>72,824,065.46</td><td>90.44</td></tr> <tr> <td></td><td>资产支持证券</td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td></td><td>贵金属投资</td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>e</td><td>金融衍生品投资</td><td>-</td><td>-</td></tr> <tr> <td>e</td><td>买入返售金融资产</td><td>-</td><td>-</td></tr> </tbody> </table>	2	固定收益投资	72,824,065.46	90.44		其中：债券	72,824,065.46	90.44		资产支持证券	-	-		贵金属投资	-	-	e	金融衍生品投资	-	-	e	买入返售金融资产	-	-
2	固定收益投资	72,824,065.46	90.44																								
	其中：债券	72,824,065.46	90.44																								
	资产支持证券	-	-																								
	贵金属投资	-	-																								
e	金融衍生品投资	-	-																								
e	买入返售金融资产	-	-																								

实际控制人: 陈有安	住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006W	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-	管理金融资产及其他基本基金
客户服务热线: 400-8888-888	办公地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006W	6 银行存款和结算备付金合计	4,986,164.97	6.19	截止2012年12月31日
联系电话: 010-66569430	法定代表人: 马令海	7 其他资产	2,709,343.62	3.36	2
联系人: 田薇	联系电计: 010-58321388-1105				
网站: www.chinastock.com.cn	客服电话: 010-58325327				
(2) 海通证券股份有限公司	网站: jxj.chinastock.com.cn				
注册地址: 上海广东路688号					

	办公地址：上海广东路688号 法定代表人：王开国 联系电话：-021-23219275 联系人：李奕鸣 客户服务电话：95653 网址： www.itheoc.com	(13) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司 住所：北京市朝阳区建国路88号9楼15层1809 办公地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809 法定代表人：唐宁 联系人：王巨明 联系电话：010-52855650	8 报告期末按行业分类的股票投资组合 注：本基金本报告期末未持有股票。 9 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 注：本基金本报告期末未持有股票。	80,519,574.05	100.00
			9 报告期末按债券品种分类的债券投资组合		

注册地址:深圳市福田区中一路1012 号国信证券大厦16-26 层 办公地址:深圳市罗湖区笋岗路1012 号国信证券大厦16-26 层 法定代表人:何如 联系电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 联系人:周杨	网址:www.yixinfund.com (14) 泛华普益基金销售有限公司 住所: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:黄颀	序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比 例(%)	<table border="1"> <tr> <td>1</td> <td>国家债券</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>央行票据</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>金融债券</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> <tr> <td></td> <td>其中:政策性金融债</td> <td>--</td> <td>--</td> </tr> </table>	1	国家债券	--	--	2	央行票据	--	--	3	金融债券	--	--		其中:政策性金融债	--	--
1	国家债券	--	--																
2	央行票据	--	--																
3	金融债券	--	--																
	其中:政策性金融债	--	--																

收 部	客户服务电话:95536	联系电话:028-84252471	4	企业债券	55,019,500.00	96.89
利债券	网址:www.guosen.com.cn	客服电话:400-8878-566	5	企业短期融资券	--	--
	(4) 申方宏源证券有限公司	网址:www.pyfxtx.cn	6	中期票据	--	--
保基金	注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层	(15) 中期时代基金销售有限公司	7	可转债	17,804,565.46	31.35
	办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层	住所:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号	8	其他	--	--
金基金	法定代表人:李刚	办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层				
	股票交易证:Q11-37389888	法定代表人:李刚				

金 鹏	联系人:曹陈	联系人:侯英建	9 合计	72,824,065.46	128.24
	客户服务电话:95523或4008895523	联系电话:7010-59539888	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		
华证中 基金经	电话委托:021-962505	客服电话:400-8888-160	序号	债券代码	债券名称
	网址:www.swhysc.com	网址:www.citicofund.com			
券基	(5) 华西证券股份有限公司	(16) 深圳鹏元基金销售有限公司	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
	注册地址:四川省成都市陕西路239号	(住所:深圳市福田区福华三路卓越世纪中心1号楼1806-1810			
			1	12665	12项交
				300,000	30,720,000.00
					54.10

合 伙 基 金	办公地址: 深圳市深南大道4001号的时代金融中心18楼 法定代表人: 杨国祥 联系人: 李益强 联系电话: 010-68716150 传真: 028-86150615 客户服务咨询电话: 400-8888-818 网址: www.hx168.com.cn	办公地址: 深圳市福田区福华一路卓越世纪中心1号楼1806-1810 法定代表人: 卓毓盛 联系人: 王辉辉 联系电话: 0755-33378953 客服电话: 4006-877-899 网址: www.dowinfund.com (17) 北京增财基金销售有限公司	2	124304	13合创投	200,000	20,050,000.00	35.31
			3	110029	浙能转债	72,000	10,036,080.00	17.67
			4	113501	落指转债	31,760	5,561,493.60	9.79

(6) 长城证券有限责任公司
 注册地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
 办公地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
 法定代表人: 黄耀华
 联系电话: 0755-83516289
 联系人: 刘阳
 网址: www.cgws.com

住所: 北京市西城区南土路66号建威大厦1208室
 办公地址: 北京市西城区南土路66号建威大厦1208室
 法定代表人: 王昌庆
 联系人: 罗细安
 联系电话: 010-67000988
 客服电话: 400-601-8811
 网址: www.cwsec.com.cn

[illegible]

联系人:刘毅	法定代表人:何如	(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和结盈明细	基金附
联系电话:0755-82022442	联系人:吴群莉	本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。	基金附
客户服务电话:400 600 8008,95532	联系电话:0755-82021106	(3) 本期国债期货投资评价	基金附
网址:www.china-invs.cn	传真:0755-82021165	本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。	基金附
网址:www.china-invs.cn	(三) 境外事务	1. 投资相关报告附注	基金附
3,319.	注册地:北京市西城区南口大街9号1号楼楼层金融中	名称:北京市商天公诚律师事务所	基金附
3,319.	办公地址:北京市西城区南口大街9号1号楼楼层金融中	名称:北京市朝阳区建路77号 易华园大厦写字楼 34 层	基金附

3. 法律 法定代表人: 张志刚	负责人: 赵洋	或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。	日自 或前 时因
司增聘 联系人: 唐蔚	办公地址: 北京市朝阳区建国路 77 号恒安中心 3 号楼 34 层	(3) 本基金投资的前十名股票没有违反基金合同规定的备选股票。	3 3 3
及费发 联系电话: 010-63080985	联系电话: (010) 58091000; (0755) 23982200	(3) 其他资产构成	3 3 3
司比下 客服热线: 400-800-8899	传真: (010) 58091001; (0755) 23982211		3 3 3
网址: www.cindaasc.com	联系人: 黄亮		3 3 3
(9) 安信证券股份有限公司	经办律师: 孔雨泉、黄亮		3 3 3

元,较	注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元 办公地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元 深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1楼层	(四) 会计师事务所 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 法定代表人:王卫华 法定代表人:杨信昭 联系电话: (021) 23238888 经办注册会计师:单峰、魏佳爽	3 应收股利	-	本基
未增加			4 应收利息	2,384,662.50	理人
网上			5 应收申购款	314,664.00	圳分
6%。	联系电话:0755-82825551 传真:0755-82568356 联系人:陈剑虹		6 其他应收款	-	允许
盛而进			7 待摊费用	-	依(

客户服务热线: 4008001001		联系人: 魏佳亮	四、基金的名称		8 其他	-	3.33
网站: www.sse.com.cn		(10) 广州证券股份有限公司	粤华实业债纯债债券型证券投资基金(基金简称: 粤华实业债纯债债券; 基金		9 合计	2,709,343.62	3.33
注册地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层。		代码: 000063	(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券券面				