

【上接D53版】

注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座9层  
 办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座9层  
 法定代表人:李刚  
 联系人:张传海  
 联系电话:029-63387256  
 客户服务电话:400-860-8866  
 传真:029-69447611  
 网址: www.kysec.com  
 (96) 联讯证券  
 注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼  
 办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼  
 法定代表人:徐刚  
 联系人:李俊  
 电话:0752-2119700  
 传真:0752-2119113  
 客户服务电话:956564  
 公司网站:http://www.lxsec.com  
 (97) 信达证券  
 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号5层  
 办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座P40-43  
 法定代表人:何亚刚  
 联系人:李刚  
 客户服务热线:400-889-5618  
 网址:www.csc618.com  
 (98) 平安证券  
 注册地址:深圳市福田区中心区金田路4036号卓越大厦16-20层  
 办公地址:深圳市福田区中心区金田路4036号卓越大厦16-20层  
 法定代表人:谢永林  
 联系人:周玉  
 联系电话:021-38637436  
 客户服务电话:95511-8  
 传真:021-58991896  
 网址: www.cs.pingan.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:李刚  
 联系电话:0351-8639650  
 客户服务电话:95573或400-666-1618  
 传真:0351-8618619  
 网址:www.i618.com  
 (100) 上海证券  
 注册地址:上海市浦东新区四川中路213号7楼  
 办公地址:上海市四川中路213号久事商务大厦7楼  
 法定代表人:李俊杰  
 联系人:王芬  
 联系电话:021-53686262  
 客户服务电话:021-962518  
 传真:021-5368100, 021-53682000  
 网址:www.962518.com  
 (101) 申万宏源西部证券  
 注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005A  
 办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005A  
 法定代表人:李季  
 联系人:李巍  
 联系电话:010-88085858  
 客户服务电话:400-800-0562  
 网址:www.shysec.com  
 (102) 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:曹慧  
 联系电话:021-33889888  
 客户服务电话:95523, 4008895523  
 传真:021-33882224  
 网址:www申万宏源.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40A/42层  
 办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40A/42层  
 法定代表人:姜晓军  
 联系人:陈静东  
 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.cscso.com.cn  
 (104) 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号高新发展大厦四楼  
 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:杨鹏  
 电话:027-87107535  
 传真:027-87618983  
 客户服务电话:4008005000  
 公司网站:http://www.tfzq.com/ (105) 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:甘蕾  
 联系电话:020-38289026  
 客户服务电话:400-8888-133  
 传真:020-38289588  
 网址:www.wljz.com.cn  
 (106) 西部证券  
 注册地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层  
 办公地址:西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层  
 法定代表人:刘建武  
 联系人:张华  
 联系电话:029-87406168  
 客户服务电话:029-956812  
 传真:029-87067010  
 网址:www.westsec.com.cn  
 (107) 西南证券  
 注册地址:重庆市江北桥区北浩角  
 办公地址:重庆市江北桥区北浩角西南证券大厦  
 法定代表人:余维佳  
 联系人:张磊  
 联系电话:023-63799633  
 客户服务电话:4008006036  
 传真:023-65786212  
 网址:www.swsec.com.cn  
 (108) 湘财证券  
 注册地址:湖南省长沙市天心区湘中路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:李欣  
 联系电话:021-69634510-89193  
 开放式基金咨询电话:400-888-1561  
 开放式基金业务传真:021-68906680  
 网址:www.xcsc.com.cn  
 (109) 新时代证券  
 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
 办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
 联系人:田海军  
 联系人:田芳芳  
 联系电话:010-83661146  
 客户服务电话:4006989838  
 网址:www.xsdz.cn  
 (110) 信达证券  
 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院2号楼  
 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院2号楼  
 法定代表人:张志刚  
 联系人:田静  
 联系电话:010-63081000  
 客户服务热线:95321  
 传真:010-63080978  
 网址:www.cindasc.com  
 (111) 兴业证券  
 注册地址:福州市湖东路268号  
 办公地址:上海浦东新区民生路1199弄正大道口广场1号楼20层  
 法定代表人:兰荣  
 联系人:夏中春  
 联系电话:0691-38281963  
 客户服务电话:95626  
 网址:www.xyzq.com.cn  
 (112) 银河证券  
 注册地址: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:陈有安  
 联系人:刘娟  
 联系电话:010-66560292  
 客户服务电话:4008-888-8888  
 传真:010-66568900  
 网址:www.chinastock.com.cn  
 (113) 招商证券  
 注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座36-45层  
 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座36-45层  
 法定代表人:宫少林  
 联系人:黄婵君  
 联系电话:0755-82943666  
 客户服务电话:95565, 400-8888-111  
 传真:0755-82943630  
 网址:www.newone.com.cn  
 (114) 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6/7  
 法定代表人:吴承根  
 联系人:陈静  
 联系电话:021-80108618  
 客户服务电话:95345  
 传真:021-80106010  
 网址:www.stocke.com.cn  
 (115) 中银证券  
 注册地址:南昌市长子滩红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼  
 办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41楼  
 法定代表人:王宜四  
 联系人:史江磊  
 联系电话:010-64818301  
 客户服务电话:400-8866-567  
 传真:0791-8670178  
 网址:www.avicsec.com  
 (116) 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  
 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼27层及28层  
 联系人:杨善宇  
 联系电话:010-65051166  
 客户服务电话:400-881-8088  
 网址:www.cicc.com.cn  
 (117) 中山证券  
 注册地址:深圳市福田区科技中路西华强高新大厦7楼B层  
 法定代表人:吴永良  
 联系人:罗艺璇  
 联系电话:0101022211  
 网址:www.zszq.com.cn  
 (118) 中泰证券  
 注册地址:济南市市中区经七路60号  
 法定代表人:李玮  
 联系人:王静  
 联系电话:0531-68889095  
 网址:www.zts.com.cn  
 (119) 中天证券  
 注册地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街22甲  
 办公地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街22甲  
 法定代表人:马功勤  
 联系人:王力华  
 电话:024-23298010  
 传真:024-23298034  
 客户服务电话:4006190315  
 公司网站:http://www.stocken.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层-21

层及第40层1,02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23,24  
 办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层及21层  
 法定代表人:高涛  
 联系人:王玉琳  
 联系电话:0755-82026907  
 客户服务热线:95532  
 网址:www.china-invsc.com  
 (121) 中银建投证券  
 注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼  
 办公地址:北京市朝阳区门内大街188号  
 法定代表人:王常青  
 联系人:殷雪  
 开放式基金咨询电话:95657  
 开放式基金业务传真:010-65182261  
 网址:www.cs01.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:谢斌  
 联系电话:010-60838888  
 传真:010-60833729  
 客户服务热线:95548  
 网址:www.cs.citic.com  
 (123) 中信建投证券  
 注册地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层  
 办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层  
 法定代表人:杨宝林  
 联系人:吴忠超  
 联系电话:0631-85022326  
 客户服务电话:956548  
 传真:0631-85022305  
 网址:www.citicsd.com  
 (124) 中信证券  
 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:管爱军  
 联系人:闫月旭 范春梅  
 联系电话:0371-66959882  
 联系传真:0371-66585889  
 客户服务电话:95377  
 网址:www.citicsec.com  
 (125) 长城证券  
 注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室  
 办公地址:上海市浦东新区浦东南路550号裕阳国际大厦16层  
 法定代表人:张跃伟  
 联系人:李静瑜  
 电话:021-20618122  
 传真:021-20691861  
 客服热线:400-820-2899  
 公司网站:www.ccsc.com.cn  
 (126) 招商证券  
 注册地址:深圳市福田区益田路3015号2楼215A  
 办公地址:深圳市福田区益田路3015号2楼215A  
 法定代表人:梁睿  
 联系人:秦旭  
 电话:010-616154828  
 传真:010-61607529  
 客户服务电话:400-6262-818  
 公司网站:www.zsitch.com  
 (127) 大冶金石  
 注册地址:南京市建邺区江东中路369号国睿大厦一期B座4楼A506室  
 办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号光大广场1楼  
 法定代表人:张黎明  
 联系人:朱真卿  
 电话:18616752315  
 传真:021-22268089  
 客户服务电话:400-928-2266/021-22267995  
 公司网站:www.dytz.com.cn  
 (128) 大智慧  
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元  
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元  
 法定代表人:申健  
 联系人:白海霞  
 电话:021-20219188  
 传真:021-20219259  
 客户服务电话:021-20219931  
 公司网站:https://8.com.cn/ (129) 还债宝  
 注册地址:四川成都武侯区簇锦街道锦地中心1101室  
 办公地址:四川省成都市锦江区东大街99号平安金融中心1501室  
 法定代表人:于海峰  
 联系人:陈金红  
 联系电话:029-84262474-808  
 客户服务热线:4008-588-588  
 公司网址:www.pyfund.cn  
 (130) 富济财富  
 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:深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室  
 法定代表人:齐小贺  
 联系人:刘勇  
 电话:0755-83999007-814  
 客户服务电话:0755-83999026  
 公司网站:www.jinrui.com.cn  
 (131) 海银基金  
 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  
 法定代表人:刘斌  
 联系人:王廷理  
 电话:021-80133507  
 客户服务电话:400-808-1016  
 公司网站:www.fundhaiyin.com  
 (132) 好景基金  
 注册地址:上海市虹口区四川路196号2号楼14楼1号  
 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室  
 法定代表人:杨文斌  
 联系人:张磊  
 联系电话:021-20613600  
 客户服务电话:400-700-9625  
 网址:021-68969161  
 网址:www.ehowbuy.com  
 (133) 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:王刚  
 联系人:刘洋  
 电话:021-20835879  
 传真:021-20835879  
 客户服务电话:400-920-0022  
 公司网站:http://licaike.hexun.com/ (134) 恒丰证券  
 注册地址:北京经济技术开发区宏达北路10号五层B122室  
 办公地址:北京市朝阳区东三环北路20号乐成中心A座2层  
 法定代表人:梁斌  
 联系人:王博宇  
 电话:010-57756074  
 客户服务热线:4008-980-618  
 公司网站:www.hbfund.com  
 (135) 济安财富  
 注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号A座40层4001室  
 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座40层 济安财富  
 联系人:李海燕  
 电话:010-65303616  
 传真:010-65338939  
 客户服务电话:400-075-6663(济安财富官网) 400-071-6766(腾讯财

富) 400-071-6766(腾讯财  
 富)  
 公司网站:www.jianfortune.com  
 (136) 汇付金融  
 注册地址:上海市黄浦区中山南路100号9层  
 办公地址:上海市徐汇区虹漕路1801号7楼  
 法定代表人:金伟  
 联系人:陈云升  
 电话:021-33323999  
 传真:021-33323837  
 客户服务电话:400-820-2819  
 公司网站:www.hifund.com.cn  
 (137) 新基基金  
 注册地址:北京市朝阳区西望路1号1号楼1603  
 办公地址:北京市朝阳区西望路1号1号楼1603  
 法定代表人:董雷  
 联系人:李博宇  
 电话:010-56890666  
 客户服务电话:400-068-1176  
 公司网站:www.jinji.com.cn  
 (138) 济安财富  
 注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号A座40层4001室  
 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座40层 济安财富  
 联系人:李海燕  
 电话:010-65303616  
 传真:010-65338939  
 客户服务电话:400-075-6663(济安财富官网) 400-071-6766(腾讯财  
 富)  
 公司网站:www.jianfortune.com  
 (139) 金葵城  
 注册地址:杭州湾跨海大桥云路43号金葵集团(锦昌大厦)1幢10楼1001室  
 办公地址:杭州湾跨海大桥云路65号金葵集团(锦昌大厦)  
 法定代表人:徐黎云  
 联系人:米舒岚  
 电话:021-96769629  
 传真:021-96769629  
 客户服务电话:400-8877-780  
 公司网站:www.cfd10.com  
 (164) 中信期货  
 注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层  
 1301-1305室、14层  
 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层  
 1301-1305室  
 法定代表人:张皓  
 联系人:洪斌  
 电话:0755-23963913  
 客户服务电话:400-83217421  
 传真:0755-83217421  
 客户服务热线:400-990-8826  
 公司网站:http://www.citicsf.com/ (165) 中正达正  
 注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  
 办公地址:上海市黄浦区延安路301号弘基大厦4楼  
 法定代表人:陈武斌  
 联系人:程佳豪  
 电话:021-9235020  
 传真:021-63332523  
 客户服务电话:4006-433-389  
 公司网站:www.lingxiantan.com  
 (142) 利得基金  
 注册地址:上海市金山区吕山路9475号1033室  
 办公地址:上海浦东新区虹山路911弄61号10号楼12楼  
 法定代表人:彭伟年  
 联系人:李海珍  
 电话:021-59497361  
 传真:010-64789016  
 客服电话:400-059-8888

公司网站: http://www.wy-fund.com  
 (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:魏琦  
 联系人:李莉  
 电话:020-83799249  
 联系人:余贇  
 电话:020-83799249  
 (三) 律师事务所和经办律师  
 名称:广东信达律师事务所  
 地址:广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层  
 负责人:程秉  
 电话:020-38799345  
 传真:020-38799345-200  
 经办律师:黄晶、陈桂华  
 联系人:黄贞  
 (四) 会计师事务所和经办注册会计师  
 本基金的法定验资机构为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。会  
 计师事务所:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
 主要经营场所: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:Wu Aibert Kong Ping 魏桂平  
 电话:(010)58153000  
 传真:(010)58188286  
 经办注册会计师:吕华、魏巍英  
 联系人:许建超  
 电话:010-58382010  
 客户服务热线:400-166-1188  
 公司网站:http://88.jrc.com.cn  
 (148) 瑞穗天下  
 注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室  
 办公地址:北京朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层  
 法定代表人:蒋煜  
 联系人:徐长征、周超  
 电话:01068170943,010-68170963  
 客户服务电话:4000-1818-188  
 公司网站: www.shengshiview.com  
 (149) 敦米基金  
 注册地址:杭州市余杭区仓前街一西路1218号1栋202室  
 办公地址:浙江杭州西湖区黄龙时代广场17楼A座6楼  
 法定代表人:陈裕青  
 联系人:陈益彬  
 联系电话:0571-26888888  
 客户服务电话:4000-766-123  
 网址:http://www.fund123.cn  
 (150) 天弘基金  
 注册地址:天津市滨海新区天津大道190号212楼2层  
 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3202号7楼  
 法定代表人:其实  
 联系人:潘世友  
 联系电话:021-54509988  
 客户服务电话:400-918-188  
 传真:021-64383000  
 网址:www.1234567.com.cn  
 (151) 同圆顺  
 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:浙江省杭州市余杭区五常街道同圆顺18号同花顺大厦四层  
 法定代表人:凌晓平  
 联系人:吴昊  
 联系电话:0571-88911818  
 客户服务电话:4008-773-772  
 传真:0571-88980043  
 网址:www.tyfund.com.cn  
 (152) 鑫鼎惠  
 注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504  
 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504  
 法定代表人:陈海生  
 联系人:王冠廷  
 电话:0692-3122727  
 传真:0692-3122727  
 客户服务电话:400-918-0808  
 公司网站:www.xind.com.cn  
 基金销售网站:www.dhsc.com.cn  
 (153) 新合众  
 注册地址:北京市海淀区北四环西路68号理想国际大厦906室  
 办公地址:北京市海淀区北四环西路68号理想国际大厦903室  
 法定代表人:张凯  
 联系人:任文江  
 客户服务电话:010-62675369  
 网址:fund@taifund.com.cn  
 (154) 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A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:吴雪涛  
 联系人:刘栋栋  
 电话:010-88312877  
 传真:010-88312089  
 客户服务电话:400-001-1566  
 公司网站:www.yifucapital.com  
 (155) 宜信基金销售有限公司  
 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商  
 务秘书有限公司)  
 办公地址:北京市朝阳区金田路2028号宜信商务中心2405  
 法定代表人:华强盛  
 联系人:刘娜  
 电话:0755-23919688  
 传真:0755-89801035  
 联系人:陈静  
 电话:0755-89801956-811  
 公司网站:www.yixinfund.com  
 (156) 宜信证券  
 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1509  
 联系人:王廷理  
 电话:010-62885173  
 客户服务电话:400-6099-200  
 公司网站:www.yixintan.com  
 (157) 宜信基金销售有限公司  
 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商  
 务秘书有限公司)  
 办公地址:北京市朝阳区金田路2028号宜信商务中心2405  
 法定代表人:华强盛  
 联系人:刘娜  
 电话:0755-23919688  
 传真:0755-89801035  
 联系人:陈静  
 电话:0755-89801956-811  
 公司网站:www.yixinfund.com  
 (158) 宜信证券  
 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1509  
 联系人:王廷理  
 电话:010-62885173  
 客户服务电话:400-6099-200  
 公司网站:www.yixintan.com  
 (159) 增财基金  
 注册地址:北京市朝阳区南礼士路66号建威大厦1208室  
 办公地址:北京市西城区德胜门内大街166号建威大厦1208-1209室  
 法定代表人:罗安俊  
 联系人:史丽娟  
 电话:010-67000988  
 传真:010-67000988-6000  
 客户服务电话:400-001-18811  
 公司网站:www.zcfc.com.cn  
 (160) 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:北京市朝阳区安富路15-1号德信新闻大厦1层  
 法定代表人:周俊杰  
 联系人:王磊  
 联系电话:010-62020088  
 客户服务电话:400-888-6661  
 网址:www.myfund.com  
 (161) 中银北证  
 注册地址:北京市西城区车公庄大街4号6号楼1层  
 办公地址:北京市西城区车公庄大街4号6号楼1层  
 法定代表人:徐福胜  
 联系人:李勇  
 电话:010-62922745  
 客户服务电话:400-600-0030  
 公司网站:www.bzfunds.com  
 (162) 中期资产  
 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11103号  
 办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层  
 法定代表人:姜新  
 联系人:侯英健  
 电话:010-65807865  
 传真:010-65807894  
 客户服务电话:96162  
 公司网站: www.zqfund.com  
 (163) 中信建投期货  
 注册地址:重庆市中区中山三路107号上站大楼平层11-B、名义层11-A、  
 8-4、9-B、C

| 序号        | 债券品种        | 公允价值(元)        | 占基金总资产比例(%) |
|-----------|-------------|----------------|-------------|
| 1         | 国债债券        | 120,394,581.40 | 0.88        |
| 2         | 央行票据        | -              | -           |
| 3         | 金融债券        | 470,389,000.00 | 3.42        |
| 其中:政策性金融债 |             | 470,389,000.00 | 3.42        |
| 4         | 企业债券        | -              | -           |
| 5         | 企业短期融资券     | -              | -           |
| 6         | 中期票据        | -              | -           |
| 7         | 资产支持证券(可转换) | 881,940.00     | 0.01        |
| 8         | 其他          | -              | -           |
| 9         | 其他          | -              | -           |
| 10        | 合计          | 602,077,421.40 | 4.31        |

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  | 150416 | 16国债16 | 3,500,000 | 360,350,000.00 | 2.69         |
| 2  | 150419 | 16国债19 | 1,200,000 | 120,120,000.00 | 0.87         |
| 3  | 019046 | 15国债06 | 420,000   | 420,700.00     | 0.00         |
| 4  | 019059 | 15国债09 | 417,640   | 417,794,820.00 | 3.03         |
| 5  | 019006 | 09国债06 | 59,970    | 9,988,999.80   | 0.07         |

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。  
 8. 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股指期货交易情况说明  
 本基金本报告期末未投资股指期货。  
 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
 本基金本报告期末未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注  
 (1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。  
 (2) 本基金投资的前十名股票没有出现在基金合同约定的备选股票库中。  
 (3) 其他资产构成表

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,727,704.22   |
| 2  | 应收证券清算款 | 189,569,700.00 |
| 3  | 应收利息    | -              |
| 4  | 应收股利    | 13,228,006.61  |
| 5  | 其他应收款   | 715,362.10     |
| 6  | 其他流动资产  | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 206,239,423.31 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
 (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限原因   |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 300222 | 科大讯飞 | 687,269,166.54 | 5.03         | 重大资产重组停牌 |

11. 基金的业绩  
 本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,也不保证基金份额净值。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在进行投资决策前应仔细阅读基金招募说明书。  
 本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年12月31日)的业绩表现及与同期基准的比较如下表所示:

| 阶段          | 净值增长    | 净值增长率 | 业绩比较基准  | 业绩比较基准增长率 | ①-③    | ②-④   |
|-------------|---------|-------|---------|-----------|--------|-------|
| 2015年12月31日 | -17.00% | 2.37% | -17.52% | 1.87%     | -0.08% | 0.50% |

12. 费用概览  
 (一) 基金费用的种类  
 1. 基金管理人的管理费;  
 2. 基金托管