

工银瑞信四季收益债券型证券投资基金(LOF) 更新的招募说明书摘要

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司 人:中国农业

西城区金融大街5号,甲5号6层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901 京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层 念人馬之市時不存在近条網天系。 基金柱器人 統:中国农业银行报价有限公司(简称中国农业银行) 统:中国农业银行报价有限公司(简称中国农业银行) 水市,北京市东坡区建国门内大街28号凯晨世贸中心东催 促代表人,刘士,2009年1月15日 市设立和庆年和市场设立发导,中国银监会银监复[2009]13号 途社行业务规律及等。中国证监会银监复[2009]13号 途社行业务规律及等。中国证监会银监案子[1998]23号 海路周阳;持续监禁 海路周阳;持续监禁 (4.54) (公司网站: www.icbcs.com.cn 2.代前机构 (1) 中国工商银行股份有限公司 (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55号 办企地址:北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人/要建商 传载:400—661/9744 8户服务电话:95588

接近代表人工开国 財産人を金子 未実确。 电话,1021—23219275 (传真:021—646027222 客户服务电话:195553 同性:由野/Www.becc.com/ (8)申力/宏龍近寿有限公司 注那地址:上海市命信正长代系約989号45层(邮編:200031) 法元元代表的事情。 地域:1021—33389888 电话,1021—33389888 电点,1021—33389888 电点,1021—333898888 电点,1021—3338988888 同位,由于中心地,1021—333898888 同位,由于中心地,1021—33388888 同位,由于中心地,1021—33388888 同位,由于中心地,1021—3338888 同位,由于中心地,1021—333888 电话,1021—333888 电话,1021—333888 电话,1021—333888 电话,1021—333888 电话,1021—33388 电话,1021—3338 电话,1021—3338

	基金管理人 基金托管人
注册地址:深圳市深南路7088号招商银行力	Σ.厦A层
在加速址:北京朝阳区新源南路6号京城大 古定代表人:王东明 联系人:陈忠 电话:010-84588888	厦
传真:010-84865560 客户服务电话:010-8458888 岡址:http://www.cs.ecitic.com/	
(13)中原证券股份有限公司 注册地址,郑州市郑东新区商务外环路10 ⁵ 办公地址,郑州市郑东新区商务外环路10 ⁵ 法定代表人,菅明军	2, 7, 2, 7,
法定代表人;菅明军 联系人;程月艳 范春艳 电话;0371—6909882 传真;0371—65585899	
客户服务电话:0371-967218;4008139666 网址:http://www.cnew.com/ (14)信达证券股份有限公司 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 法定代表人:高冠江 联系人:唐静	1号楼
电话:010—63080985 传真:010—63080978 客户服务电话:4008008899	
同址:http://www.cindasc.com (15)广州证券股份有限公司 注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路 注定代表人,刘东	85号广州国际金融中心19、20楼 85号广州国际金融中心19、20楼
由迁。020_88836999	
传真:020-88836654 客户服务电话: 961303 网址:http://www.gzs.com.cn (16) 練邦正券有限责任公司	
(16)德邦证券有限责任公司 注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半 办公地址:上海市浦东新区福山路500号城 注定代表人:方加春 联系人:罗芳	續9楼 建国际中心26楼
电话:021-68761616 传真:021-68767981 変户服条由话:4008888128	
网址:http://www.tebon.com.cn (17)中秦证券股份有限公司 注册地址:出东省济南市经十路20518号 办公地址:山东省济南市经七路86号23层	
法定代表人:学师 联系人:吴阳	
电话:0531—81283938 传真:0531—81283900 客户服务电话:95538 网址:http://www.qlzq.com.cn/ (18) 华福证券有限责任公司	
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦 办公地址:福州市五四路157号新天地大厦	7、8层 7至10层
法定代表人:黄金琳 联系人:张腾 电话:0591-87383623 传真:0591-87383610	
客户服务电话;96326(福建省外请加拨059 网址;http://www.hfzq.com.cn	
(19)渤海证券股份有限公司 注册地址:天津市经济技术开发区第二大约 办公地址:天津市南开区宾水西道8号 法定代表人:王春峰 联系人:王兆权	f42号写子楼101室
电话:022-28451861 传真:022-28451892 客户服务电话:4006515988	
网址:http://www.bhzq.com (20)厦门证券有限公司 注册地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦- 办公地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦-	七七楼
伝定1、収入: 博教料 联系人: 卢金文 电话: 0592—5161816	T Life
传真:0592-5161102 客户服务电话:0592-5163588 网址:http://www.xmzq.cn	
決定代表人:董永成	29号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层 29号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层
客服电话:4008-169-169	
四组: www.aton.com. (22) 华龙证券股份有限公司 注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号 办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路6 法定代表人,李晓安 联系人,李昕田	38号财富大厦
联系人:李听田 电话:0931—888088 传真:0931—4890515 客户服务电话:0931—4890619 4890618 489	20100
(23)深圳众禄基金销售有限公司 注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号级	京展銀行大厦25楼1.1单元
法定代表人:薛峰 联系人:童彩萍 联系电话: 0755-33227950	9C/ICIGC1377(9C=27)0.* V/T=70
传真: 0755-82080798 客户服务电话: 4006-788-887 网址: www.zlfund.cn及www.jjmmw.com	
(24)北京展恒基金销售有限公司 注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6 办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北皇 法定代表人:闫振杰	号 12号民建大厦6层
联系人:宋丽冉 联系电话: 010-62020088 客服电话:4008-886-661	
传真: 62020088-8802 岡址: www.myfund.com (25)上海天天基金销售有限公司 注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号	楼二层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C 注定代表人:其实 联系人:潘世友 联系电话:021-54509988-7019	座9楼
联系电话:(021-54509988-7019 客服电话:400-1818-188 传真:021-64385308 网址:www.1234567.com.cn	
(26)杭州数米基金销售有限公司 注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路系 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3	F2号 588号恒生大厦12楼
法定代表人;陈柏青 联系人;周雄旻 电话;0571-28829790,021-60897869 客服电话:4000-766-123	
传真;0571-26698533 网址:http://www.fund123.cn/ (27)上海好买基金销售有限公司 注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号	TIN
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多男 法定代表人:杨文斌	4号楼449室 行国际大厦9楼
联系人:薛年 联系电话:921-58870011-6705 客服电话:400-700-9665 传真:021-68596916	
阿址;http://www.ehowbuy.com/ (28)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问 注册地址;上海市金山区廊下镇漕廊公路7 九八地址。上海市金山区廊区银槽市路など界	有限公司 650号205室 +(什-今)动力式の#*
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号 注定代表人;汪静波 联系人;李玲 联系电话:021-38602750	11 CZZ HZC.T., C. Odbo
客服电话:400-821-5399 传真:021-38509777 网址: http://www.noah-fund.com/ (29)和讯信息科技有限公司	
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利 办公地址:北京朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人:王莉	小大厦10层 【
联系人:习甜 联系电话:010-85650920 客服电话:400-920-0022	
传真。010-85657357 岡址:http://licaike.hexun.com/ (30) 浙江金观城财富管理有限公司 注册地址:洪蟴区霞湾巷239号8号楼4楼40 办公地址:杭州市教工路18号EAC欧美中心	增
办公地址:杭州市教工路18号EAC政美中心 注定代表人:陆彬彬 联系人:鲁盛 联系电话:0571-56028617	AED区8层
客服电话:400-068-0058 传真:0571-56899710	
网址: www.jincheng-fund.com (31)上海利得基金销售有限公司 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号103 办公地址:上海东方路989号中达大厦2楼	室
法定代表人:盛大 联系人:徐雪吟 联系电话:021-50583533-3011 客服电话:400-005-6355	
	1
(327上海下温盛金捐音)及页则可用收公 注册地址:上海市浦东新区高翔路526号刺 办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号 法定代表人:张跃伟 联系人:单丙牌	格景国际B座16层
联系电话:021-20691832 変服由话:400-089-1289	
传真: 021-20691861 网址: http://www.erichfund.com (33) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公言 注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科打	引 支园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号国公 注定代表人:马令海 联系人: 邓洁 联系电话: 010-58325388-1105	≥大厦C座9层
 (34) (10.5 abc) (10.5 abc) (24) (25) (25) (25) (25) (25) (25) (25) (25	
(34)一路财富(北京)信息科技有限公司 注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五 办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万 法定代表人:吴雪秀	株大楼C座702 通新世界广场A座2208
低定代表允;美当券 联系人;苏昊 联系电话:010-88312877-8033 客服电话:400-001-1566	
网址;www.yilucaifu.com (35)海银基金销售有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路1217号1	6楼B単元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号1 法定代表人:刘惠 联系人;冯立 联系电话:021-80133535	366.0年ル
客服电话:400-808-1016	0.116
(36)上海大智慧财富管理有限公司 注册地址:上海浦东杨高南路428号1号楼1 办公地址:上海浦东杨高南路428号1号楼1 注定代表人,申健 联系人;付江	アル医)-11层
版系人:付江 联系电话:021-20219988*31781 客服电话:020-20219931 姆止https://8.gw.com.cn/ (37) 泛华普益基金销售有限公司	
(37)泛华普益基金销售有限公司 注册地址:成都市成华区建设路9号高地中 办公地址:四川省 成都市辖江区下东大街 联系人:付勇斌	心1101室 216号喜年广场A座1502室
电话:028-86758820 传真:028-86758820-805 安昭由话:4008-588-588	
岡址:www.pyfund.com.cn/ (38) 上海陆金所资产管理有限公司 注册地址.由同(上海)自由贸易过险区陆	家嘴环路1333号 14楼09单元 3号14楼
法定代表人:郭坚 联系人:宁博宇 电话:031-20665952	
传真:021-22066653 客户服务电话: 4008219031 网址:www.lufunds.com (39)北京乐融多源投资咨询有限公司	
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号标 办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号标 办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号标	§16层1603室 § 16层1603室

#. www.jmmfund.com 上海東等春产量和有限公司 排他上·日耳(上海) 自由贸易试验区富特北路277号3层310室 提供上·温南千枚宁区福泉北路518号8号楼3层 於代表人。嘉禄 各.7; 凌秋梅 唐.021-52822063

	基金管理有限公司 银行股份有限公司
	电话:021-63333319 存真:021-63332523
	客户服务电话: 4000 178 0000 网址: www.lingxinfund.com (42) 深圳市游彩富寶建有限公司 生那炒此: 深圳市前海深港各作区前湾一路1号A林201室(人驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办入炒油: 深圳市前海深路各作区前湾一路1号A林201室(人驻深圳市前海商务秘书有限公司)
	法定代表人、孝小贺 族系人、刘勇 専選・の755-83999907-813 専選・0755-83999926 客学服务単語・5755-83999907
	照計: www.jinqinwo.cn \$43\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\
	法定任義人, 渠客 既系人: 赵治路 起活: 010-66154828 传真: 010-88867526
	客户服务电话:010-66154828 网盘: www.Sinch.com 4+ 中证金年·(运议) 投资咨询有限公司 4年期後此:13京市丰台区东省关-152号楼2-45室 DAV地址:13京市丰台区东省关-153号号楼2-45室 DAV地址:13京市青虹(万外大田中-号新华杜第三工作区A座5层
	法定代表人
	条 開発电话: 4 008909998
	力必要性,潮北省武汉市江汉区建设大道933号 注意代表人,海新民 航系人,泽斯 电影-027-8268-6704 春集,027-8268-623
	客服电话: 96558 (武汉) 4006096558 (全国) 砌址 : www.hkbchina.com (46) 在亲宏女者命业银行股份有限公司
	注册操性。广东省东莞市东地区湾福东路2号 办公地址;广东省东莞市东城区湾福东路2号 驻宏代表人何沛良 族条人系持细霉 重花。1070—22866254
	表真: 6679-22866282 客服电話: 0769-961122 斑bwww.drchank.com
	(47)宁坡银行使份有限公司 主册地社, 浙江省宁坡市赣州区宁南南路700号 办公地社,浙江省宁坡市赣州区宁南南路700号 坛宏代表人,瑞华裕 联系人,胡建始
	也許。0574-89068340 #萁,0574-87050024 宏麗世話,95574
	(48)国都证券股份有限公司「南大街3号国华投资大厦9层10层 比别使此:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 法定市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 法定代表人/高档
	例比: www.goodu.com 客戸服务电话:60-818-8118 4(49) 中日画版に储蓄銀行変化有限公司 上部微化: 北京中西域な金融大切号
	力公地址:北京市西城区金融大街3号 法定代表人,李国华 族系人,陈春林 有英-101-68858117 李严解务电话:9580
	网肚: http://www.psbc.com (50)天风证券股份有限公司 卡珊柚帖: 湖北省武汉市在湖縣枝术开发区关在园路2号高科大厦4楼
	力/シ樹址
	公司网址.http://www.tfa_com (51) 兴业银行股份有限公司 生册地址:福州市湖东路54号
	かた地址: 上海市江宇路168号 生産化夫人、高雄平平 底系人、河冷 車話の21~52,259999
	窓限柱法, 955cl Mit. www.db.com.cn (52) 中国副所金融有限公司 生那般此,中国北京建国门外大街1号 国贸大厦2维28层
	生形型比。中国北京建国门外大街市号 国贸大厦2座28层 水之型比。中国北京建国门外大街市号 国贸大厦2座28层 安定代表人。金立群 泰名人·罗春宴 武明明 电话·010-65051166 传真·100-65051156
	客户服务电话; (010)85679238/85679169; (0755)83195000; (021)63861195; 63861196 例址: http://www.cicc.com.cn/ 1 长元: https://www.cicc.com.cn/
	场內代納机构具有基金代銷資格的深圳证券交易所场內会员单位、(具体名单见基金份额发售公告) 基金管理人可模据(中华人民共和国证券投资基金法)、(公开募集证券投资基金运管管理办法)、(证券投资基金销售管理 体基金基金合同等的规定。选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。 一句证券記机构 中国证券記述接有限责任公司
	注册费性::北京西域区逾越大街27 号投资广场23 层 注册整合证率为4%地址:北京市西域区太平桥大街17号 注定代表力、周阳 过去:010~9378856
	程與-1016-9378007 既系人:組織 (三) 津映時事务所及经办律师 名 除:13次德恒律师事务所
	注 所;此定市西域区金融街19号高凯大厦B盛十二层 办处地上:此京市西域区金融街19号高凯大厦B盛十二层 负责人:王明 起 话;(010)66575888 传 真;(010)65232181
	(注) (2) (2) (2) (2) (2) (2) (3) (3) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4
	少公理证: 上语市研除路边25号字字/语中心11接 经办法用会计师: 许康特 (王鳴字 联系电话: [102] 12323888
	表 真: (021)2328800 灰条人: 車号: 辺. 基金的会称 本並を今秋、「銀端信門季吹沓備奉寄正券得帝基金 (LOF)
	石.基金的燃型 水基金类型(债券型基金 六.基金的运作方式 本金子于时间编码后的次日起(即2014年2月10日)转为上市开放式基金(LOF),投资人可进行基金份额的申购与赎回。
	七·投資自称 在严格控制风险与保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。 八·投资范围 ·格基金的投资应用包括具有良好流动性的企业债。公司债,短期融资券,地方政府债,商业银行金融债与次级债,可转换债券(
埋	本基金的投资范围组括具有良好强动性的企业情,公司借,短期融资券,地方政府借,渝业银行金融情与次级债。可持续债券、 定易局可转换费等,分离之转证案。结争间略,组成,中央银行原理、政策省全盈债,银行存款等周证效益类产,是现取权证 发资产,以及注律法规或中国证监会分价基金投资的其他金融工具,法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基 人在银行运当程序后,可以将其纳人投资范围。 基金是投资组合管产配置比例,债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%;其中公司情,企业债,短期融资券,商业 融售与次级债。企业资产支持证券,可转换债券(各分度交易的可转换债券)等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产 不低于80%。股票等效是资产品是金资产的比例和超过20%。基本类类换多开发式基金目记了以后,基金特有现金及
例金	不底于80%。提票等权益参算产占基金资产的比例不超过20%。本基金转换为开放式基金(LOF)以后,基金持有现金及到期 年以均的政研销等占基金资产的股的比例不属于5分。 本基金可以通过参与新股申助,增发新核。可转换债券转股票,权证行权以及要约收购类股票套利等低风险的投资方式来提 收益水平。但此类投资低两杯超过基金资产的20%。
信	办。基金的投资策略 (一)投资额的 本基金在深入分叶固定收益品种的投资价值的基础上,采用久期管理等组合管理策略,构建债券组合,通过重点投资公司债, 车企业机本发行的固定收益金融工具,以获取相对稳定的基础收益,同时,通过新股申购,增发新段,可转换债券特股票,权证
析	及要给欢晚海投票乘利等投资方式来摄高基金收益水平。 《产化置郭璐 本基金采取自上间下的方法进行组合资产配置。研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征,采取定性分析和定 相结合的方法,考虑经济环境,获取取的、资金供求、信用风险、多类资产和对信值等因素。研判各国局定收益类资产与新使申曝
例	新級。可換除债券特股票,以证行仅以及要约收购类股票套利等权益类资产投资的风险收益预期,以确定各类金融资产的配。 (局定收益类资产投资策略 (1)债券组合设度策略。 (1)债券组合设度策略。 (2)债券组合设度策略。 (2)债券组合设度策略。 (3)债券组合设度策略, (3)债券组合设度策略, (3)债券组合设度策略, (3)债券组合设度策略, (3)债券组合设度策略, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等, (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债券组合设度等。 (3)债务组合设度等。 (3)债务组合设度等。 (3)债务组合设度等。 (4)债务。 (4)债务。 (
i o	①久期餘%
期券	基于利率预期理控。分析未来较长,经时间优加未来;平市市场利率的变化趋势,如来预期市场利率将上升,导致中长期债券 收益任于短期债券或者货币市场工具收益时,则将债券组合人期售全校的水平而在预期利率太平稳定或者下降,导致中长 持有收益高于短期债券和货币市场工具收益时,则将债券组合人期上调至较高水平。 空期损益检查增额解
时	在确定组合人期房基础上,基基金计划收益率曲线形态象化确定合理的组合期限结构。包括采用于弹策略。硬铃轭除和熔形 在长期,用排取删储券间进产品态调整。——操而当。当期增收益率曲线变速时,本基金将采用于弹策略;当预削收益率曲线 将采用邮铃轭略;在预期收益率曲线不变或平行移动时,则采用梯形策略。 (2) 企业机构类像分投资源器
利	本基金通过研究市场整体信用风险趋势,结合企业机构类债券的供需情况以及替代资产相对吸引力,研判信用利差趋势,并 年风险、风险证明合约企业机构类价券的投资比例 1.0企业(公司)情投资原源 在企业机构美规模比例确定之后进行个券选择。信用风险和能动性风险是影响个券相对价值的主要因素。根据国民经济运
期行為企	在企业和典率情况完计例确定之后进行个参赛核。信用风险和能力性风险是影响个参和对价值的主要因素。根据国际经济运 协议。分析企业(公司)信等委员士人所处于设建的国意、发展状态。形态物位、自参校及、曾继承平和特务水平包括、产品 人物信用风险、并根据特定债券的设行变的、评价债券的信用级别、根据单个债券等则收益率相对于市场收益率由他的偏离 各当信用等级。则则、滤动性、果息率、选择权条款、税赋特点等因素,确定其相对投资价值、选择具有相对价值且信用风险较 业(公司)债券进行投资。
値	问程機能勞兼果尺益类证券与制定收益类证券的特性,具有抵御下行风险,分享取票价格上涨收益的特点。 本基金将选择公司基本素能使L实故应的基础证券有着较高,还裁力的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量 工具评定其投资价值,以合理价格买人并持有,本基金持有的可转换债券可以转换为股票。 3.企业资产支持证券投资额路
的	企业资产支持证券是中中国证监会批准的企业资产支持证券类品种,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持 构成及压量、提销修还率等。 本基金领景人分析上连基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。 非逻辑类等之种等
<u>险</u>	(1)新假申與投資縮絡 在股票投行市场上,股票供求关系不平衡经常导致职票发行价格与二级市场价格之间存在一定价差,从而使新股申购成为一 校低的投资方式,本基金将研究首次发行股票(PO)及增发新股的上市公司基本面因素,根据股票市场整体定价水平,估计新
根	文句的上述印在"开学"。 3401-1670 金印水火水,从加加的企品起的的农业等38944。平成业本等的,2012 参与的农业场的农村等1952 统 建作出场价格和对于其合理内在自然的能。 (2)建省收购的投票现货资额的 基金条件分分党制化推取使用场场存在的固定收益机会。在有效控制风险的前提下参与要约收购类股票的投资。该类投资立作的局定收益类特征,可收购人发布要等取购后进行投资。基金条件分价的放益。风险和皮本测算基础上,结合是票市场运程基本面分析,并在分价作品判断要求取纳投资。
浦	限基本面分析,并在充分评估和判断要约收购人的综合实力和收购意愿的前提下,诸旗参与要约收购类股票的投资。 (3)校证投资破路 本基金不主动投资权证,因持有股票或可分离债而获得的权证,在有效控制风险的前提下,本基金将在对权证标的证券进行 前牙及恰值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,并结合未采标的证券的定价 有效耗和越售。

2011.2.10-2011.12.31 2014.2.10-2014.12.31 20.42% 2015.1.1-2015.12.31 12.10% 本基金管理人实行"投资决策委员会领导下的团队制"管理模式,建立了严谨、科学的投资管理流程,具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程,如图1-1所示。

传换债:	金为债券型基金,属于 基金主要投资于公司 券)等企业机构发行的	(1)信、企业信、短期融	资券、商业银	行金融借与	次级债、企业资产	'支持证券、	可转换债券(含	分离交
十二.	、基金投资组合报告 资组合的报告期为20	15年10月1日起至12						
1.1 打 序号	设告期末基金资产组合 可	合情况 6目		金額(テ	Ē)	占基	金总资产的比值	列(%)
1	权益投资				16,271,380.00			1.
	其中:股票				16,271,380.00			1.
2	基金投资				-			
3	固定收益投资				1,190,824,762.66			83.
	其中:债券 资产支持证券				1,190,824,762.66			83.
4	贵金属投资				-			
5	金融衍生品投资				-			
6	买人返售金融资产			-				
	其中:买断式回购的	的买人返售金融资			-			
7	银行存款和结算备	付金合计			178,709,806.67			12
8	其他资产				47,259,270.23			3.
9	合计				1,433,065,219.56			100
任:由 1.2 拍	3于四舍五人的原因金 设告期末按行业分类的	è額占基金总资产的 的股票投资组合	比例分坝之村	0与台计可图	19年2月1日日本			
代码		5业类别		公允	价值(元)	- E	基金资产净值	七例(%)
A B	农、林、牧、渔业					-		
С	制造业				29.540	.00		0
D	电力、热力、燃气及			5,726,000	.00		0	
Е	建筑业					-		
F	批发和零售业	ier m II.				-		
G	交通运输、仓储和的	耶政业			6,132,000	.00		0
H	住宿和餐饮业 信息传输、软件和f	言息技术服务业			4,383,840	- 00.00		0
J	金融业				.,,070	-		
K	房地产业					-		
L	租赁和商务服务业					-	·	
M	科学研究和技术服 水利 环境	务业 和公共设施管理业				-		
N O		和公共设施管理业 修理和其他服务业				_		
P	ALPRING ST S	教育				-		
Q		和社会工作				-		
R	文化、	本育和娱乐业				-		
S		综合 合计			16.0=1.5	-		
注:由	于四舍五人的原因2		净值的比例分	} 项之和与台	16,271,380 计可能有尾差。	.00		1
	3于四舍五人的原因公 设告期末按公允价值。	占基金资产净值比例	大小排序的	前十名股票技	设资明细		占基金资产	4. /4 LL /
序号	股票代码	股票名称	数	量(股)	公允价值	(元)	(%)	
1	600037	歌华有线		200,000		306,000.00		0
2	000089	深圳机场		500,000		080,000.00		0
3	600023 601139	浙能电力 深圳燃气		400,000	,	996,000.00 730,000.00		0
5	600798	宁波海运		300,000		052,000.00		0
) 2,1			
6	603508	思维列控		1,000		77,840.00		0
_	603508	思维列控 中新科技)			0
6 7 1.4 打	603996 股告期末按债券品种领	中新科技 分类的债券投资组合		1,000)	77,840.00 29,540.00	-	0
6	603996 股告期末按债券品种领	中新科技		1,000)	77,840.00 29,540.00 占基	金资产净值比	例(%)
6 7 1.4 打 序号	603996 设告期末按债券品种外债	中新科技 分类的债券投资组合		1,000	直(元)	77,840.00 29,540.00 占基	金资产净值比	例(%)
6 7 1.4 排 序号 1	603996 设告期末按债券品种分 债: 国家债券 央行票据 金融债券	中新科技 分类的债券投资组合 参品种	7	1,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0	77,840.00 29,540.00 占担 0	金资产净值比	例(%) 6
6 7 1.4 排 序号 1 2 3	603996 设告期末按债券品种分债。 国家债券 央行票据 金融债券 其中:政策性金融信	中新科技 分类的债券投资组合 参品种	T	1,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0	77,840.00 29,540.00 占据 0	金资产净值比	0 例(%) 6 15
6 7 1.4 指 序号 1 2	603996 设告期末按债券品种 债: 国家债券 央行票据 金融债券 其中:政策性金融付 企业债券	中新科技 分类的债券投资组合 参品种	T	1,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0	77,840.00 29,540.00 占据 0	金资产净值比	0 例(%) 6
6 7 1.4 拼 序号 1 2 3	603996 设告期末按债券品种分债。 国家债券 央行票据 金融债券 其中:政策性金融信	中新科技 分类的债券投资组合 参品种		1,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0	77,840.00 29,540.00 占基 0 - 0 0 5	金资产净值比	0 例(%) 6 15 15 82
6 7 1.4 排序号 1 2 3	603996 長告期末按债券品种/ 债: 国家债券 央行票据 金融债券 其中:政策性金融住 企业债券 企业债券	中新科技 分类的债券投资组合 券品种	T	1,000	道(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4	77,840.00 29,540.00 占基 0 - - 0 0	金资产净值比	0 例(%) 6 15 15 82
6 7 1.4 拼 序号 1 2 3 4 5 6 7 8	603996 法期末按债券品种 债: 国家债券 央行票据 金融债券 其中,政策性金融信 企业债券 企业短期赔债券 中期票据 可转债(可交换债) 同业存单	中新科技 分类的债券投资组合 券品种	T	1,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0	77,840.00 29,540.00 占基 0 - - 0 0	金资产净值比	0 例(%) 6 15 15 82
6 7 1.4 指序号 1 2 3 4 5 6 7 8	603996 信告期末按债券品种 债: 国家债券 央行票据 金融债券 址中.政策性金融估 企业债券 企业短期融资券 中期票据 可转值(可交换债) 预业存单 其他	中新科技 分类的债券投资组合 券品种		1,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349.2	77.840.00 29,540.00 占基) - -)))) - -)))) - -))) - - -))) -	金资产净值比	例(%) 6 15 15 82 26
6 7 1.4 扩 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:由	603996 估期末按债券品种 债: 國家债券 央守票据 金融债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业短期施资券 中期票据 可转破(可交换债) 可转破(可交换债) 其他 台中	中新科技 沙类的儒等投資组合 参品种 由 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市	净值的比例分	1,000 1,000 公允价 (直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349.2	77.840.00 29,540.00 占基) - -)))) - -)))) - -))) - - -))) -	金资产净值比	例(%) 6 15 15 82 26
6 7 1.4 1 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:由 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5	603996 合物果花使佛养品种 佛: 國家儒券 央行票据 金融儒券 址中:政策性金融传 企业儒券 企业服明融资券 中期票据 可转值(可交換備) 同业存单 其他 台计 中,四本有量	中新科技 分类的债券投资组合 参品种 由 市 大允价值占基金资产净值上例	大小排序的	1,000 1,000 公允价付 公允价付 分頭之和与各 前五名债券	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 232,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349.2 1,190,824,762.6 計中可能有尾差。	77.840.00 29.540.00 29.540.00 占基 5		(例(%) 6 15 15 82 26 3
6 7 1.4 扩 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:由	603996 估期末按债券品种 债: 國家债券 央守票据 金融债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业短期施资券 中期票据 可转破(可交换债) 可转破(可交换债) 其他 台中	中新科技 沙类的儒等投資组合 参品种 由 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市 市	净值的比例分 数量(1,000 1,000 公允价付 公允价付 分頭之和与各 前五名债券	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349.2	77.840.00 29.540.00 29.540.00 占基 5	占基金资产净值比 占基金资产(%)	例(%) 6 15 15 82 26 3
6 7 1.4 1 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:由 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5	603996 合物果花使佛养品种 佛: 國家儒券 央行票据 金融儒券 址中:政策性金融传 企业儒券 企业服明融资券 中期票据 可转值(可交換備) 同业存单 其他 台计 中,四本有量	中新科技 分类的储券投资组合 参品种 责	大小排序的	1,000 1,000 公允价付 公允价付 分頭之和与各 前五名债券	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2 1,190,824,762.6 计可能有是差。 公允价值	77.840.00 29.540.00 29.540.00 占基 5	占基金资产/	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
6 7 1.4 排 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:由 1.5 排	603996 治期末按债券品种 债: 國家債券 央行票据 金融債券 企业债券 企业债券 企业短期融资券 中期票据 同业存单 其他 合计 方让 方让 方能 方性 方性 合能 合。 使等 持 成 成 成 成 成 成 成 成 成 成 成 成 成	中新科技 分类的儒学技资组合	大小排序的	1,000 1,000 公允价付 公允价付 分项之和与分项之和与分项之和与参数	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 23,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2 21,190,824,762,6 20,000.0 25,840,349,2 25,756,000.0 25,840,349,2 25,840,349,2 25,840,349,2 25,840,349,2 25,840,340,349,2 25,840,340,340,340,340,340,340,340,340,340,3	77.840.00 29.540.00 占基 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	占基金资产/	00 66 155 155 82 26 3 3 134 6 6
6 7 1.4 引 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:it:f	603996 治期末按债券品种 债: 國家債券 央行票据 金融债券 赴中,政策性金融信 企业债券 企业短期融资券 中期票据 同业存单 其他 合计 -于四会五人的顾时之 战份期末按公允价值 债券代码 101453009	中新科技 分类的储券投资组合 棒品种 商 方法金资产净值上标 6余名称 14款资 MTN001	大小排序的	1,000 1,000 公允价 分项之和与否 前五名债券 张)	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 23,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349.2 1,190,824,762.6 1,1191,874,762.6 1,1191,874,762.6 54,5	77.840.00 29.540.00 占基 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	占基金资产/	00 00 66 155 155 155 155 155 155 155 155 155
6 7 1.4 拍 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注:註:五 1.5 拍 2 7 8	603996 经营期末按债券品种 债 国家债券 央行票据 金融债券 基中:政策性金融 企业债券 企业债券 企业场票据 可转值(可交换债) 同业年年 其他 合计 债券代码 101453009 150313	中新科技 分类的储券投资组合 参品种 ***********************************	大小排序的	1,000 1,000 公允价4 分项之和与各 第五名债券 张) 500,000	度(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,349.2 241,756,000.0 28,840,349.2 251,756,000.0 28,840,340.2 251,756,000.0 28,840,340.2 251,756,000.0 28,840,340.2 251,756,000.0 28,840,340.2 251,756,000.0 28,840,340.2 28,840,340.2 28,840,340.2 28,840,340.2 28,840,340.2 28,840,340.2 28,840,340.2 28,8	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	占基金资产/	00 00 155 155 155 266 33 134 66 66
6 7 1.4 拼 序号 1 2 3 4 5 6 6 7 8 9 10 注: it: it: j 1 P 序号 1 2 3 4 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1	603996 经营期末按债券品种 债 国家债券 央行票据 企业债券 法中,政策性金融 企业债券 企业债券 企业债券 企业场票据 可转缴(可交换债) 同业存单 其他 合计 行动会五人的圆段 经制制被公允价值 债券代码 101453009 150313 150205 19215 122770	中新科技 分类的储券投资组合 参品种	大小排序的i 数量(1,000 1,000 公允价付 公允价付 第五名债券 %) 500,000 400,000 400,000 400,000	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 1,190,824,762.6 1,190,824	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	00 00 155 155 155 134 134 66 66 44 44
6 7 1.4 排 序号 1 2 3 4 5 6 6 7 8 9 10 ½;;;ti 1.5 排 PF号 1 2 3 4 5 6 1.6 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5 1.5	603996 经勞斯末按债券品种 債: 國家债券 央行票据 金融债券 其中:政策性金融传 企业债券 企业短期融资券 中期票据 可转值(可交換债) 可转值(可交换债) 行为, 行为, 行为。 (债券代码) 101453009 150313 150205 019515 122770 25 期末按公允价值。	中新科技 分类的储券投资组合 参品种	大小排序的1	1,000 1,000 公允价十 公允价十 第1) 500,000 500,000 400,000 400,000 100	度(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 5,147可能有能差。 全資時期 公允价值(40,0 40,0 33,349,2 24,762,6	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	00 00 155 155 155 134 134 66 66 44 44
6 7 1.4 引 序号 1 2 3 3 4 5 6 7 8 9 10 注: t. 打 1.5 引 4 5 1.6 描 5 1.6 描 7 1.7 指 5 1.7 指 7 1.7 结 7 1.7 结 7 1.7 结 7 1.7 结 7 1.7 结 7 1.7 结 1.7 结 1.7 结 1.7 t 1.7 t 1	603996 信告期末按信券品种 债: 國家信券 央行票据 全债券 其中:政策性金融传 企业债券 企业债券 企业短期融资券 中期票据 可转值(可交换债) 同业存单 其他 估计于四余五人的原因公 债券代码 101453009 153313 150205 019515 122770 公告期末按公允价值。 公本标准的期末特有一条	中新科技 分类的儒等投資组合 参品种 方法金资产等值让多 信券名称 14铁道 MTNO01 15速出13 15国用05 15国價15 11国間01 日基金资产等值比多 成产支持证券。	大小排序的i 数量(大小排序的i 大小排序的i	1,000 1,000 公允价付 公允价付 第1) 500,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名贵金额	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 24,762.6 54,5 51,9 41,7 40,0 33,33 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 41,7 41,7 40,0 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	(() () () () () () () () () (
6 7 1.4 排 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注: ti 打 1,5 排 4 5 1,4 排 6 7 8 9 1 2 3 3 4 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1 1 5 1	603996 德等期末按债券品种 债: 國家债券 央行票据 金融债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业短期赔资券 中可契值(可交换债) 同业存单 其他 债计 十四合五人的原因经 营勤未按公允的值 债券代码 101453009 150313 150205 019515 122770 经本期未未持有 企本报年期未未持有 企本报年期末未持有 企本报年期末未持有 企本报年期末未持有 企本报年期末未持有 企本报年期末未持有 企本报年期末未持有 经有期末次允价值。	中新科技 沙英的信券投资组合 参品种 参品种 一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一种,一	大小排序的i 数量(大小排序的i 大小排序的i	1,000 1,000 公允价付 公允价付 第1) 500,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名贵金额	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 24,762.6 54,5 51,9 41,7 40,0 33,33 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 41,7 41,7 40,0 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	(() () () () () () () () () (
6 7 1.4 引 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 8 9 10 注: i.ੀ 上 5 1.7 本 5 1.7 a 5 1.7 a 5 1.7 a 5 1.7 a 5 1.7 a 1.7 a 1.7 a 1.7 a 1.8	603996 德特斯末按债券品种 廣: 國家債券 央行票据 金融債券 企业債券 企业债券 企业债券 企业短期赔资券 中可契值(可交换债) 同业存单 其他 合計 十四会五人的原因 战劳制未被公允的值 债券代码 101453009 150313 150205 019515 122770 经等期未被公允的值 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有 企本报告期未未持有	中新科技 沙英的領海投資组合 参品种 第一次的領占基金等产 有基金等产等值比的 (第一名 和 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	大小排序的i 数量(力大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i	1,000 1,000 公允价付 公允价付 第1) 500,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名贵金额	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 24,762.6 54,5 51,9 41,7 40,0 33,33 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 41,7 41,7 40,0 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	00 00 155 155 155 134 134 66 66 44 44
6 7 1.4 引 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 8 9 10 注: i. i. i. i. i. j.	603996 经营期末按债券品种 债 国家债券 央行票据 金融债券 其中,政策性金融 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业债券 企业场期 阿迪泰堡 可契缴值可交换债 同业存单 其他 合计 行30313 150205 115313 150205 115313 150205 150313 15031 150313 1503	中新科技 分素的储券投资组合 参品种 参品种 一种工作。 一种工作, 工作, 工作, 工作, 工作, 工作, 工作, 工作,	大小排序的i 数量(大小排序的i 大小排序的i 以大小排序的i 以次,排序的i	1,000 1,000 公允价付 公允价付 第1) 500,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名贵金额	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 24,762.6 54,5 51,9 41,7 40,0 33,33 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 41,7 41,7 40,0 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	00 00 155 155 155 134 134 66 66 44 44
6 7 1.4 指 8 9 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 注: t f f 1 2 3 4 5 1 6 7 8 9 1 1 2 3 4 5 1 1 6 1 7 8 8 8 9 9 1 1 8 1 8 1 8 1 8 1 8 1 8 1 8	603996 经营期末按债券品种 债 国家债券 央行票据 企业债券 其中,政策性金融 企业债券 这业值票 可转值(可交换债) 可转值(可交换债) 可转值(可交换债) 其他 合计 于四会五人的顺归 债券代码 101453009 150313 150205 019515 122770价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来 基金处设设 经营期来 基金处设设 经营期来 基金处设设	中新科技 分素的儒等投資组合 参品种	大小排序的i 数量(大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 战明	1,000 1,000 公允价付 公允价付 第1) 500,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名贵金额	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 24,762.6 54,5 51,9 41,7 40,0 33,33 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 41,7 41,7 40,0 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	00 00 155 155 155 134 134 66 66 44 44
6 7 1.4 月 序号 1 2 3 4 5 6 7 8 9 1位::t:月 1 2 3 4 5 1.6 指 1.7 禁禁, 1.8 并, 1.8 并, 1.8 并, 1.9 打, 1.9 工, 1.9 工, 1	603996 603996 信告期末按债券品种 债: 國家债券 央行票据 全址负责 强	中新科技 沙萊的儲等投資組名 参品种	大小排序的i 数量(大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i 大小排序的i	1,000 1,000 公允价付 公允价付 第1) 500,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名贵金额	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349.2 231,756,000.0 28,840,349.2 24,762.6 54,5 51,9 41,7 40,0 33,33 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 33,34 34,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 34,7 41,7 40,0 41,7 41,7 40,0 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7 41,7	77,840.00 29,540.00 占基 0 0 5 5 5 7 7 15,000.00 05,000.00 24,000.00 99,000.00	占基金资产/	(() () () () () () () () () (
6 7 1.4 1 7 8 9 10 12:15 1 7 8 9 10 12:15 1 1 2 3 4 5 5 1.6 1 1.9	603996 经营期末按债券品种 债 国家债券 央行票据 企业债券 其中,政策性金融 企业债券 这业值票 可转值(可交换债) 可转值(可交换债) 可转值(可交换债) 其他 合计 于四会五人的顺归 债券代码 101453009 150313 150205 019515 122770价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来按公允价值有 经营期来 基金处设设 经营期来 基金处设设 经营期来 基金处设设	中新科技 沙萊的儒等投資組名 参品种	大小排序的i 数量(大小排序的i 法以排序的i 选阅 期间损益。。	1,000 1,000 公允价 公允价 第五名债券 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 301,000 前十名资产 前五名核证时	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 38,840,349,2 31,940,741,7 40,0 33,3 34,756,741,7 40,0 35,741,7 40,0 35,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 40	77,840.00	占基金资产(%)	(%) (%) (155 (155 (155 (155 (155 (155 (155 (15
6 7 1.4 扩 9 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 12:15 1 1 2 3 4 5 1.6 打 4 5 1.6 1 1.9	603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 60499 60499 6049 604	中新科技 李是的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《李的信法金管产等值出的 信差金管产等值出的 信差金管产等值出的 信息。 「一直上面的。 「一直上面的。 「一直上面的。」 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,则次上行投资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 38,840,349,2 31,940,741,7 40,0 33,3 34,756,741,7 40,0 35,741,7 40,0 35,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 40	77,840.00	占基金资产(%)	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
6 7 1.4 扩 9 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 12:15 1 1 2 3 4 5 1.6 打 4 5 1.6 1 1.9	603996 合物果未按债券品种 债: 圖家债券 央行票据 金业债券 基本中、政策性金融任 企业债券 企业债券 企业债券 商: 企业债券 企业债券 商: 企业债券 企业短期融资 一切转值(可交换债) 同业 使年 其他 合计 十四合五人的原民总 营期未按公允价法 债券代码 101453009 101453003 150205 019515 122770	中新科技 李是的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《李的信法金管产等值出的 信差金管产等值出的 信差金管产等值出的 信息。 「一直上面的。 「一直上面的。 「一直上面的。」 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,例次上行投资 「一直上面的,则次上行投资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则次上行发资 「一直上面的,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则,则	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%)	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
6 7 1.4 排 6 7 1.4 排 6 6 7 8 9 10 1:: i 排 7 8 8 9 1 1.5 排 1.6 描 1.7 排 1.8 排 1.8 排 1.9 排 1.1 本 1.1 本 1.2 本 1.2 本 1.2 本 1.2 本 1.2 本 1.2 ta 1.2 ta 1.3 ta 1.4 ta 1.5 ta 1.6 ta 1.6 ta 1.7 ta 1.8 t	603996 合物果未按债券品种 债: 圖家债券 央行票据 金业债券 基本中、政策性金融任 企业债券 企业债券 企业债券 商: 企业债券 企业债券 商: 企业债券 企业短期融资 一切转值(可交换债) 同业 使年 其他 合计 十四合五人的原民总 营期未按公允价法 债券代码 101453009 101453003 150205 019515 122770	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 38,840,349,2 31,940,741,7 40,0 33,3 34,756,741,7 40,0 35,741,7 40,0 35,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 36,741,7 40,0 40	77,840.00	占基金资产(%)	00 66 155 155 151 154 26 3 3 134 4 4 4 4 3 3
6 7 1.4 并 序号 1 2 3 4 4 5 6 7 8 9 10 注: 1 1.5 并 1 2 3 4 1 2 3 4 1 2 3 4 5 6 7 8 9 1 1 1 2 3 4 4 4 5 5 6 6 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 8 7 8 8 7 8 8 8 7 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	603996 603996 信告期末按信券品种价值 個家信券 供 與行票据 全业债券 其中,政策性金融信 企业债券 其中,政策性金融信 企业债券 可转储(可交换债) 同域库单 其他 一种则常据 可转储(可交换债) 同域库单 其他 合计 十四会五人的原因组 债券个码 101453009 10145009 101450	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%)	0 (%) 6 6 155 26 26 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3
6 6 7 7 8 9 10 11:5 1 8 5 5 6 6 7 7 8 9 10 11:5 1 9 10 12:5 1 1 2 3 3 4 4 5 5 1.6 报基刊 序号 1 1 2 1 5 5 1.6 报基刊 序号 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	603996 经告期未按债券品种价值 国家债券品种价值 国家债券品种价值 国家债券品种价值 国家债券上,	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产/ (%) (%) (5) (5) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7	(%) 6 6 151 155 155 155 155 155 155 155 155
6 7 1 1 2 3 4 5 6 7 7 8 9 10 1:5 1 8 9 10 1:5 1 1:5	603996 603996 信告期末按债券品种价值 個家债券品种价值 国家债券 共中:政策性金融传券 其中:政策性金融传券 其中:政策性金融传券 其中:政策性金融传券 企业短期融资 势一可转值(可交换情)可数倍(可交换情)可数倍(可交换情)101453009 150313 150205 101453009 150313 150205 25 對末按公允分价值(是份期末按公允价的信有(是份期末按公允价值有(是份期末按公允价值有(是份期末被公允价值有(是份期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的通行	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) 6 6 151 155 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26
6 6 7 1 1 4 打 序号 1 2 3 3 4 5 6 6 7 7 8 9 10 注: i 計 7 7 8 9 10 注: i 計 1 7 7 8 7 8 7 7 8 9 10 注: i 計 1 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 8 7 8	603996 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) 6 6 151 155 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26
6 7 1 1 2 3 4 5 6 7 7 8 9 10 1:5 1 8 9 10 1:5 1 1:5	603996 603996 信告期末按债券品种价值 個家债券品种价值 国家债券 共中:政策性金融传券 其中:政策性金融传券 其中:政策性金融传券 其中:政策性金融传券 企业短期融资 势一可转值(可交换情)可数倍(可交换情)可数倍(可交换情)101453009 150313 150205 101453009 150313 150205 25 對末按公允分价值(是份期末按公允价的信有(是份期末按公允价值有(是份期末按公允价值有(是份期末被公允价值有(是份期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的信有(全本报告期末基金投资的通行	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) 6 6 151 155 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26
6 7 7 1 1 2 3 4 4 5 6 7 8 9 10 1:1:11 1.5:11 1.4:14 1.7:48 1.9:14 1.9:1	603996 603996 信告期末按信券品种价值 值 家债券 央行票据	中新科技 李基的儒等投資组合 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 李品种 《一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	大小排序的 大小排序的 大小排序的 大小排序的 法例明细验。 調點用網验。 期末出現被監	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) 6 6 151 155 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26 26
6 6 7 1 1 4 1 9 9 1 2 3 3 4 5 6 6 7 8 8 9 9 10 1 1 5 1 6 1 5 1 5 1 5 1 5 1 5 1 5 1 5 1	603996 603996 信告期末按信券品种价值 值宝信券	中新科技 分类的储券投资组合 参品种 方法金资产等值比多 债券名称 14铁道 MTNO01 15速出13 15国份15 11国份 11国份 11国份 11 11 11 11 11 11 11 11 11 1	大小排序的 数量 (1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (1) (1) (1) (26,0) (1,1)	(%) 66 151 151 151 151 151 151 151 151 151
6 7 1 1 2 3 4 5 6 7 7 8 9 10 12:1:1 1.5:1 8 9 10 1:5:1 1.6: ii.5:1 1.7: ii.5:1 1.9: ii	603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 604 604 604 604 604 604 604 604 604 60	中新科技 分类的储券投资组合 参品种 **********************************	大小排序的自然	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2 公许可能育歷系差。 公允价值(54,5 51,9 41,7 40,00 33,3 33,3 2次特证券投资明细	77,840.00 占插	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) (%) (%) (6 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4 (4
6 6 7 1 1 4 1 9 9 1 2 3 3 4 5 6 6 7 8 8 9 9 10 1 1 5 1 6 1 5 1 5 1 5 1 5 1 5 1 5 1 5 1	603996 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60	中新科技	大小排序的 数量 (1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 732,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2,274,62.6 24,745,62.6 25,745,62.6 26,741,740.0 33,33 36,741,740.0 28,840,349,2 29,741,740.0 36,741,	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (1) (1) (1) (26,0) (1,1)	00例(%) 6 151 155 26 26 3 3 134 4 4 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3
6 7 1 1 2 3 4 4 5 6 7 8 9 10 11.5 + H 8 9 10 11.5 + H 12.3 3 4 4 5 1.6 + K 1.7 + H 1.7 + H 1.7 + H 1.1 + H 1	603996 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396	中新科技	大小排序的的 数量(大小排序的) (大小排序的) (大小排序的) (大小排序的) (大小排序的) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 1,190,824,762.6 54,5 51,9 41,7 41,7 41,7 43,0 33,33,3 2校钟细 金额	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(0) (%) (6) (6) (6) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7
6 7 1 1 2 3 4 4 5 6 7 8 9 10 11.5 1 8 9 10 11.5 1 1.6 1.8 1.8 1.8 1.8 1.8 1.8 1.8 1.8	603996 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60396 60	中新科技 分类的储券投资组合 参品种 **********************************	大小排序的的 数量(大小排序的) (大小排序的) (大小排序的) (大小排序的) (大小排序的) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基) (基	1,000 1,000 公允价 (公允价 (分面之和与各 前五名债券) 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前十名资产 前五名校证的	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 1,190,824,762.6 54,5 51,9 41,7 41,7 41,7 43,0 33,33,3 2校钟细 金额	77,840.00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(0) (%) (6) (6) (6) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7) (7
6 7 7 1 1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 1:i:ii A	603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 60396 60	中新科技	大小排序的 数量 (大小排序的) 数量 (大大小排序的) 数据 (大大小排序的) (1,000 1,000 公允价 公允价 新五名债券 张) 500,000 400,000 400,000 400,000 300,000 前五名贵炎 前五名贫产 前五名贫产 300,000 前五名贫产	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 23,974,413.4 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 241,70 40,00 33,33 34,40 40,00 34,60 40,6	77,840.00 占占基	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	00 66 155 155 155 266 134 4 4 4 3 3 3 3 3 3 5 9 4 4 4 4 3 3 3 3 3 5 5 5 5 6 6 6 6 6 7 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8 7 8
6 6 7 7 1 1 4 1 9 9 1 1 2 3 3 4 4 5 6 6 7 8 8 9 1 1 1 6 1 5 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 603996 60396 60	中新科技	大小排序的 数量 () 大人小排序的 数量 () 大人小排序的 () 大人小排序的 () 大人小排序的 () 大大小排序的 () 大大小排序的 () 大大小排序的 () 对于一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是	1,000 1,000 1,000 公允价付 公允价付 公允价付 500,000 500,000 400,000 3040,000 前十名资产 前五名校证护	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 241,756,000.0 25,840,349,2 25,756,413,4 26,267,413,4 26,27,413,4 27,413,4 28,840,349,2 28,840,340,349,2 28,840,340,349,2 28,840,340,340,340,340,340,340,340,340,340,3	77,840,00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) 6 6 151 152 266 266 266 266 266 266 266 266 266 2
6 7 7 1 1 2 3 4 5 6 7 7 8 9 10 11 12 3 4 5 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	603996 60396 60396 60396 60396 60396	中新科技 李遊的傳화投資組名 泰品种 一次次的個占基金資产 方基金资产等個比包 「一方基金资产等個比包 「一方基金资产等個比包 「一方基金资产等個比包 「一方基金资产等個比包 「一方基金资产等個比包 「一方基金资产等個比包 「一方基金资产等。」 「一种企业产品。 「一种企产品。 「一种企业产品。	大小排序的 数量 () 大人小排序的 数量 () 大人小排序的 () 大人小排序的 () 大人小排序的 () 大大小排序的 () 大大小排序的 () 大大小排序的 () 对于一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是一种,是	1,000 1,000 1,000 公允价付 公允价付 公允价付 500,000 500,000 400,000 3040,000 前十名资产 前五名校证护	直(元) 60,975,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 136,279,000.0 28,840,349,2 231,756,000.0 28,840,349,2 241,756,000.0 25,840,349,2 25,756,413,4 26,267,413,4 26,27,413,4 27,413,4 28,840,349,2 28,840,340,349,2 28,840,340,349,2 28,840,340,340,340,340,340,340,340,340,340,3	77,840,00	占基金资产(%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%) (%)	(%) 6 6 151 152 266 266 266 266 266 266 266 266 266 2

5.92%

6.42%

6.05%

5.42%

2.92%

0.00%

0.14% 0.12%

0.12%

0.02%

F四、费用银管 一)月基金运作有关的费用 ,与基金运作有关的费用列示, 1)基金管理人的管理费。 3)基金合同生效百的信息披露费用; 4)基金份制度人大会费用; 5)基金合同生效与与基金相关的会计师费、律师费; 6)基金的证券免费费用; 7)基金则产拨划支付的银行费用; 8)基金上面费及平衡。 (6)基金的证券交易费用;
(7)基金的证券交易费用;
(8)基金上市费及年费;
(8)基金上市费及年费;
(9)按照国际有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。
上述基金费用由基金管型人在连律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(二)基金费用由基金管型人在连律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(二)基金管理从有透离性和支付方式。
1.基金管理从内密理费
在通常形式、基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下;
H=Ex平管理费率。当年天载、本基金年管理费率为0.0%
H为蛋白巨红性的基金管理费度
为前一日基金资产净值
上对前一日基金资产净值的年费率计据。计算方法如下;
H=Ex平行管理费率。当年天载、本基金年管理费率为0.0%
H为蛋白巨、排价管费
在通常情况下。基金行管费按前一大性支付给基金管理人,与基金产管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个作口的从基金财产中一次性支付给基金管理人,有量法定市最后,依在1.2分付日期间延。
2.基金任何人的任管费
在通常情况下,基金行管费按前,2.2%
H为蛋白巨、排价是数据分类的一个一次数据分析管费,2.4%(表面)。2.4%(表面)。2.5%(表面),2.5%(由)。3.4%(表面),2.5%(由)。3.4%(自)。3.4%(

。 4、下列费用不列人基金费用: (1)基金管理人和基金任管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; (2)基金管理人和基金任管人处理与基金运作天光的事项发生的费用; (3)基金要从期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购 70年金级集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购

-3.00% 0.12%

-2.80% 0.10%