

中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2016年第【1】号

基金管理人:中信建投基金管理有限公司 基金托管人:北京银行股份有限公司

重要提示

中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)申请募集的准予注册文件名称为:《关于准予中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2015】2256 号),注册日期为:2015 年 10 月 9 日。本基金合同于 2015 年 11 月 11 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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,但不保证基金本金一定盈利,也不保证最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金资产额持有人的本金或取回原本金投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,自主判断基金的投资价值,充分考虑自身投资的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金投资策略所特有的风险、担保风险、本基金到期期限调整所特有的风险、投资股指期货的风险和未知价风险和其他风险等。如保本周期期满后,本基金未能符合保本基金存续条件,转型为“中信建投聚利混合型证券投资基金”后将投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市公司中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债券的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指债券主体违约的风险,是中小企业私募债券最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债券交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格(利率、汇率、股票价格、商品价格等)的不确定变化带来的风险,它影响债券的实际收益率,这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

本基金为保本混合型基金,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。投资者投资于保本基金并不等于将基金作为存款存放在银行或存款类金融机构,保本基金在投资期间仍存在发生损失投资本金的风险。如保本周期期满后,本基金未能符合保本基金存续条件,转型为“中信建投聚利混合型证券投资基金”的,其预期风险和收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中高风险、中高预期收益的品种。

投资者购买本基金份额的行为视为同意基金合同或认购认购书的约定。投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自行承担投资风险,自行承担投资风险。

投资有风险,投资人投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本更新的招募说明书自募集文件生效之日起至 2016 年 5 月 11 日,有关财务数据和净值截止日已至 2016 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。本基金托管人北京银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称:中信建投基金管理有限公司
住所:北京市东城区桥梓街八号桥雅苑 3 号楼 B 座
办公地址:北京市东城区朝门内大街 2 号凯恒中心 C 座 19 层
法定代表人:蒋万利
成立时间:2013 年 9 月 9 日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监许可【2013】1108 号
经营范围:基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

组织形式:有限责任公司
注册资本:15000 万元
联系人:杨露露
电话:010-59100288
存续期间:永久存续
股权结构:中信建投证券股份有限公司占 55%、航天科技财务有限责任公司占 25%、江苏广博传媒有限公司占 20%。

二、主要人员情况
蒋万利先生,董事长,成都电子科技大学硕士研究生学历。曾任中信证券交易部总经理、长盛基金管理有限公司总经理,现任中信建投证券股份有限公司党委委员、经营发展部总经理、董事总经理,兼任中信建投基金管理有限公司董事长。

张金生先生,副董事长,总经理,首都师范大学士。曾任中信建投证券经纪业务管理部行政负责人,现任中信建投基金管理有限公司副董事长、总经理。

HVB 银行(香港银行公会)董事,德耀国际大学硕士研究生学历。曾任德国 HVB 银行(香港银行公会)董事,中信建投证券股份有限公司资产管理部总监,中信建投基金管理有限公司总经理,现任中信建投基金管理有限公司常务副总经理、职工董事,兼任元达信资产管理(北京)有限公司执行董事。

刘丽娟女士,董事,哈尔滨工业大学硕士研究生学历。曾任航天科技财务有限责任公司总经理助理,现任航天科技财务有限责任公司总经理。

安树才先生,董事,南京大学商学院硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台财务资产部主任,现任江苏省广播电视总台经营管理部主任。

杜建成先生,独立董事,北京大学法律硕士研究生学历。曾任北京市律师协会职员,中国中联律师事务所所律师,现任北京市融商律师事务所高级合伙人、律师,现任北京市融商律师事务所主任。

王汀汀女士,独立董事,北京大学博士研究生学历。现任中央财经大学副教授。

王胜利女士,独立董事,北京师范大学硕士研究生学历。曾任北京瑞达会计师事务所副经理,北京中洲光华会计师事务所高级经理,天津正信会计师事务所合伙人

人事负责人)人力资源委员会委员兼北京资产管理委员会、大学会计师事务所合伙人兼财务负责人)人力资源委员会委员,现任大学会计师事务所合伙人兼战略发展和市场管理委员会委员。

陈永华先生,独立董事,上海财经大学博士研究生学历。香港科技大学博士,历任上海财经大学会计学院助教、副教授、教授,现任南京大学商学院会计学副教授、博士生导师,会计与财务研究院副院长。

孔祥女士,监事会主席,中国人民大学金融专业研究生学历。曾任中国工商银行财务处副处长,华夏证券财务、稽核、清算部部门总经理,现任中信建投证券股份有限公司运营管理部行政负责人。

许会芳女士,监事,中国人民大学商学院金融硕士研究生学历。现任航天科技财务风险管理部与法律部副经理。

周婉女士,监事,南京大学会计学硕士研究生学历。曾任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展副科长,现任江苏省广播电视总台投资管理部业务拓展科科长。

张金先生,职工监事,中国人民银行研究生部金融硕士研究生学历。曾就职于中信建投证券债券承销部、债券销售交易部、资本市场部,现任中信建投基金管理有限公司总经理助理,兼任元达信资产管理(北京)有限公司总经理。

陈海先生,职工监事,北京工业大学博士。曾就职于平安证券信息技术部网络管理部,中信建投证券信息技术部网络管理部,现任中信建投基金管理有限公司信息技术部总监。

王瑞先生,中国人民大学金融专业博士。曾任大通证券研发中心研究员,中关村证券研发中心研究员,中信建投证券交易部总监,现任中信建投基金管理有限公司总经理助理。

三、高级管理人员
蒋万利先生,现任公司董事长,简历同上。

张金生先生,现任公司副董事长、总经理,简历同上。

张金生先生,现任公司常务副总经理、职工董事,简历同上。

周婉女士女士,北京大学在职研究生学历,曾任航天科技财务有限责任公司人力资源部总经理、资产管理部副经理、交易部总经理,现任中信建投基金管理有限公司督察长、兼任元达信资产管理(北京)有限公司执行监事。

四、本基金基金经理
王浩先生,中央财经大学证券投资管理专业硕士。曾任中信建投证券资产管理部经理,现任中信建投基金管理有限公司投资研究部基金经理。

五、投资决策委员会成员
张金生先生,简历同上。

袁野先生,简历同上。

王瑞先生,中国人民大学金融专业博士。曾任大通证券研发中心研究员,中关村

证券研发中心研究员,中信建投证券交易部总监,现任中信建投基金管理有限公司总经理助理。

周广先生,南开大学硕士研究生。曾任渤海证券研究员、广发证券研究员、国金证券及其下属基金公司研究员,现任中信建投基金管理有限公司投资研究部研究员。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基本情况
名称:北京银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街 17 号
办公地址:北京市西城区金融大街 17 号
法定代表人:闫冰竹
成立时间:1996 年 1 月 29 日
组织形式:股份有限公司(上市)
注册资本:人民币 1,056,019,147 万元
批准设立机关及文号:中国人民银行,银复[1995]470 号
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可【2008】776 号
联系人:赵越
联系电话:(010) 6622 3605
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;从事同业拆借;提供担保;代收收付款项;代理保险业务;提供保管箱业务;办理地方财政信用周转使用资金的委托贷款业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;同业外汇拆借;国际结算;结汇、售汇、外汇票据的承兑和贴现;外汇担保;资信调查、咨询、见证业务;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券;自营和代客外汇买卖;证券结算业务;开放式证券投资基金代销业务;债券结算代理业务;短期融资券主承销业务;经中国银行业监督管理委员会批准的其它业务。

二、发展概况
北京银行成立于 1996 年,是一家中外资本融合的新型股份制银行。成立以来,北京银行持续保持经济“稳增长”的良好态势,先后实现总行、上市、跨区域及南昌等 10 大中心城市以及香港、青岛有 400 多家分支机构,发起设立北京延庆、浙江文成及吉林农安银行村镇银行,发起设立国内首家消费金融公司——北京消费金融公司,首批试点合资设立中德法人货币银行,先后设立中加基金托管公司、北银贵金属托管公司,开群和探索了中小银行创新发展的新模式。

截至 2015 年 12 月末,北京银行总资产达到 1.84 万亿,年内总资产突破 2 万亿,实现净利润 168.39 亿元,成本收入比 24.99%,不良贷款率 1.12%,拨备覆盖率为 278%,资本充足率 12.27%,各项经营指标均达到国际银行先进水平,公司信用评级名列中国区域性发展银行首位,品牌价值 263.15 亿元,一级资本排名全球千家大银行 87 位,连续两年跻身全球银行百强,被誉为“中国最具创新能力和发展潜力的中、小银行”。

20 年来,北京银行积极履行社会责任,在医疗、教育、慈善、救灾等方面向社会捐助超过 1.5 亿元,充分彰显了企业社会责任感。凭借良好的经营业绩和优质的金融服务,北京银行赢得了社会各界的高度赞誉,先后荣获“全国文明单位”、“亚洲 10 大最佳银行”、“中国最佳城市商业银行”、“最佳区域性银行”、“最佳支持中小企业贡献奖”、“最佳便民服务银行”、“中国上市公司百家企业”、“中国社会责任优秀企业”、“最具持续投资价值上市公司”、“最受尊敬银行”、“最值得百姓信赖的银行机构”及“中国优秀企业公民”等称号。

第三部分 相关服务机构

一、基金销售代理机构
1、直销机构
名称:中信建投基金管理有限公司
住所:北京市怀柔区桥梓镇八号桥雅苑 3 号楼 1 室
法定代表人:蒋万利
办公地址:北京市东城区朝门内大街 2 号凯恒中心 C 座 19 层
传真:010-59100288
联系人:贾欣欣
客户服务电话:4009-108-108
网址:www.cfundf.com

2、其他销售机构
(1)北京银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街 17 号
办公地址:北京市西城区金融大街 17 号
法定代表人:闫冰竹
联系人:刘章
客户服务电话:95526
网址:www.bankofbj.com.cn

(2)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区东直门路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:阮晓
客户服务电话:95587,400-8888-108
网址:www.csc108.com

3、各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的有关公告。

二、登记机构
名称:中信建投基金管理有限公司
住所:北京市怀柔区桥梓镇八号桥雅苑 3 号楼 1 室
办公地址:北京市东城区朝门内大街 2 号凯恒中心 C 座 19 层
电话:010-59100228
传真:010-59100298
联系人:陈莉君
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层
负责人:俞卫锋
电话:021-31358660
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陆奇
联系人:陆奇
四、审计计基金财产的会计师事务所
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 号展恒大厦 6 楼
办公地址:上海市湖滨路 200 号普华永道中 11 楼
法定代表人:杨绍辉
电话:021-23238800
传真:021-23238800
联系人:张勇
经办注册会计师:许康伟、张勇

中信建投稳利保本 2 号混合型证券投资基金

第五部分 基金类型

混合型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标
本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期增值。

第七部分 基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的债券、股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、股指期货以及其他法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产,稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等,其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%,其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券、权证、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%。

第八部分 基金的投资策略
一、投资策略
本基金运用固定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简称 CPPI 策略),动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金保本周期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目标。具体而言,本基金的投资策略包括大类资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。

1、大类资产配置策略
本基金在大类资产配置上采取 CPPI 策略对稳健资产和风险资产进行配置,动态调整稳健资产与风险资产的投资比例,来实现保本和增值的目标。具体来说,该策略通过对稳健资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全,通过对风险资产的投资寻求保本周期内资产的增值增值。

结合 CPPI 策略,本基金对稳健资产和风险资产的资产配置可以分为以下四步:

第一步,确定价值底线(Floor)。根据本基金保本周到期时投资组合的最低目标价值(本基金的最低保本值为投资本金的 100%)和合理的贴现率,确定当前应持有的稳健资产数额,亦即价值底线(Floor)。

第二步,计算安全垫(Cushion)。通过计算基金投资组合现时净值超过价值底线的数额,得到安全垫(Cushion)。

第三步,确定调整乘数(Multiplier)。本基金通过对宏观经济和证券市场运行态势进行趋势的判断,并结合风险收益特征,确定投资组合中安全垫的放大倍数,也就是风险调整乘数,并在安全垫和风险调整乘数的基础上,得到当期风险资产的最高配置比例。

第四步,动态调整稳健资产和风险资产的配置比例,并结合市场环境实际进行态势制定风险资产投资策略,进行投资组合管理,实现基金资产在保本基础上的保值增值。

2、稳健资产投资策略
本基金通过综合分析宏观经济运行趋势、财政政策、货币政策等,对市场的收益

率走势及信用环境变化作出判断,并综合考虑不同债券类证券资产变化的趋势特征,具体、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等多种因素,在确保基金资产资金安全性和稳定性的基础上,构建债券组合。

(1) 免役策略
本基金采用剩余期限与保本周期期限动态匹配的投资策略,参照保本周期的剩

余期限,动态调整稳健资产债券组合久期,以有效控制资产变动风险,维护债券组合收益的稳定性。

(2) 收益率曲线策略
本基金将结合对市场收益率曲线变化的研究,适时采用子弹、杠铃或梯形策略构

造投资组合,并进行动态调整,从短、中、长期债券的相对价格变化中获利收益。

(3) 相对价值策略
本基金通过对不同债券市场、债券品种及信用等级等的债券间利差的分析判断,获取相对价值定价偏差所带来的投资收益。

(4) 期限策略
本基金通过分析收益率曲线各期限利差情况,买入收益率曲线最陡峭处所对应的

期限债券,持有一定时间后,随着债券剩余期限的缩短,到期收益率将快速下降,从而获得较高的期限利差带来的资本利得收入。

(5) 回购策略
本基金将适时运用回购交易套利策略,在确保基金资产安全的前提下增强债券

组合的收益率。

(6) 信用债投资策略
本基金将采用内部信用评级和外部信用评级相结合的方法,通过对信用产品基

本面的研究,形成对该类信用产品信用评级综合评定,并通过调整组合内信用产品在

不同等级和期限方面的分布,获取超额收益。

3、股票投资策略
本基金将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,从行业 and 个股

两个方面进行深入研究,精选具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估价格于合理区间内股票,构建股票组合。

1) 行业配置策略
本基金将密切关注国内宏观经济运行情况以及国内各项政策,深入分析各行业的发展状况、景气度以及政策影响,对具有良好发展前景的行业、景气程度高或处于拐点的行业,以支持行业充分获得未来成长的行业进行重点配置。

2) 个股选择策略
本基金将坚持价值投资理念,立足于公司的财务状况及发展前景,通过估值手段

对公司价值进行合理判断,并结合股票的价格对其投资价值进行科学判断;同时,

时,本基金将充分结合中国资本市场自身特点和运行规律,发掘出投资价值被市场低

估的投资品种,以获取优化的投资回报。

(2) 权证投资策略
本基金将权证投资以权证的市值分析为基本,配以权证定价模型寻求其合理

估值水平,以主动式的科学投资策略为手段,充分发掘权证资产的投资性、流动性

及风险性特征,通过资产配置、品种与风格选择,追求基金资产稳定的中期收益。

(3) 股指期货投资策略
本基金基于套期保值目的投资以符合基金合同规定的保本策略投资目标为前提进

行。本基金以套期保值为目的,根据股指期货的原理,在风险可控的前提下,投资于

流动性好、交易活跃的投资期指合约,有效管理投资组合的系统性风险,积极改善组

合的风险收益特征。

第九部分 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:前两年银行定期存款税后利率扣除基金管理人决定的保本周期开始后前两年银行定期存款税后利率后与银行定期存款基准利率(按期间 5 年 5 日的方法)保留到 1 小数点后第 2 位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期的税后收

入率。本基金是保本型基金,保本周期为两年,保本但不保证收益。以两年期银行定期存款税后收益率为本金的业绩比较基准,能够使本基金投资者理性判断基金

的预期风险收益特征,合理地衡量比较本基金保本的有效性。

如果今后法律法规发生变化,或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用,又或者市场出现更具权威、且更能表征本基金风险收益特征的业绩比较基准,则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后调整本基金业绩比较基准并报中国证监备案,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。
第十部分 基金的风险收益特征
本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告
基金管理人及董事、监事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2016 年 6 月复核了本报告中的财务指标、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。

本报告投资组合所数数据截至 2016 年 3 月 31 日(摘自本基金 2016 年第一季度报告),本报告中所列财务数据未经审计。

一、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	58,219,713.88	3.24
其中:股票	58,219,713.88	3.24	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,593,664,900.80	88.56
其中:债券	1,593,664,900.80	88.56	
资产支持证券	-	-	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	117,000,575.50	6.50
其中:买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	13,583,883.77	0.88
8	其他资产	14,761,329.73	0.82
9	合计	1,799,478,403.68	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	41,201,995.88	2.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	10,665,918.00	0.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,351,800.00	0.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	58,219,713.88	3.24

三、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

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(%)
1	002335	积存宝	199,902	8,483,840.88	0.47
2	002019	亿帆医药	130,000	6,591,400.00	0.39
3	000002	万科 A	260,000	6,351,800.00	0.35
4	002445	中南重工	300,172	5,973,422.80	0.33
5	300182	康捷医疗	300,000	5,438,000.00	0.30
6	002410	广联达	386,700	5,235,918.00	0.29
7	300296	利亚德	220,000	5,220,600.00	0.29
8	002688	华泰证券	249,987	5,149,732.20	0.29
9	600703	三安光电	250,000	4,915,000.00	0.27
10	000060	中金岭南	400,000	4,468,000.00	0.25

四、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(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,027,000.00	5.02
其中:政策性金融债	90,027,000.00	5.02	
4	企业债券	262,889,210.00	14.65
5	企业短期融资券	912,244,000.00	50.83
6	中期票据	20,991,000.00	1.17
7	可转债(可交换债)	585,000.00	0.03
8	同业存单	297,930,000.00	16.60
9	其他	-	-
10	合计	1,593,664,900.80	88.79

五、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	111669223	16 皖发 CD023	1,000,000	99,330,000.00	5.53
2	111617011	16 皖发 CD201	1,000,000	99,300,000.00	5.53
3	111669221	16 皖发 CD202	1,000,000	99,200,000.00	5.53
3	150222	15 附息 22	900,000	90,027,000.00	5.02
4	122395	15 渣打债	550,000	57,420,000.00	3.20
5	160313	16 苏沪 01	500,000	50,660,000.00	2.82

六、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。

七、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。

八、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。

九、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货持仓。

2.本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货持仓。