

(上照B42E) 法定代表人:周萍芳 注册地址:北京西城区德胜门内大街115号德胜尚城B座 联系电话:(020)-38173635 业务传真:(020)-38173857 客服电话:(400-830-8001) 公司网址:www.gdbank.com (110) 名称:中国民生银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区金融大街2号 法定代表人:洪崎 联系电话:(010)-59355941 客服电话:40088-99618 公司网址:www.cmbchina.com (111) 名称:方正证券股份有限公司 注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段22号 法定代表人:廖宇 联系电话:(010)-59360670 业务传真:(010)-59360655 客服电话:(400)-620-0020 公司网址:www.fundao.com.cn (112) 名称:开普森投资有限公司 注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门30层55室 法定代表人:李海 联系电话:(029)-88583234 业务传真:(029)-88583234 客服电话:(95871) 公司网址:www.fundao.com.cn (113) 名称:中财期货股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区东三环北路115号德胜尚城B座1103号 法定代表人:董耀 联系电话:(010)-68307519 业务传真:(010)-68307519 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.cmfchina.com (114) 名称:中融汇金销售有限公司(北京) 注册地址:北京市朝阳区东三环北路115号德胜尚城B座1103号 法定代表人:董耀 联系电话:(010)-68307519 业务传真:(010)-68307519 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.zhongrong.com.cn (115) 名称:上海利得基金销售有限公司 注册地址:上海市虹口区四川北路1919号10楼12楼 法定代表人:沈琦 联系电话:(021)-50108567 业务传真:(021)-50108567 客服电话:(400)-620-6620 公司网址:www.lidder.com.cn (116) 名称:江苏苏宁基金销售有限公司 注册地址:江苏省南京市雨花台区软件大道11号苏宁总部大厦11楼1103室 法定代表人:王斌 联系电话:(025)-29593133 业务传真:(025)-29593133 客服电话:(400)-620-6620 公司网址:www.snjfund.com.cn (117) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路192号 法定代表人:范一飞 联系电话:(021)-68757231 业务传真:(021)-68757231 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.spdb.com.cn (118) 名称:上海银行股份有限公司 注册地址:上海市中山东二路150号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68761111 业务传真:(021)-68288888 客服电话:(95558) 公司网址:www.bankofshanghai.com (119) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (120) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号 法定代表人:范一飞 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95558) 公司网址:www.spdb.com.cn (121) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (122) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (123) 名称:中国建设银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区金融大街25号 法定代表人:王洪章 联系电话:(010)-68307519 业务传真:(010)-68307519 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.ccb.com.cn (124) 名称:交通银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人:彭纯 联系电话:(021)-58781234 业务传真:(021)-58408283 客服电话:(95559) 公司网址:www.bankcomm.com (125) 名称:富国基金管理有限公司 注册地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609A102室 法定代表人:陈慧 联系电话:(021)-68621111 业务传真:(021)-68621111 客服电话:(400)-610191 公司网址:www.fundoc.com.cn (126) 名称:东吴证券股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号2楼2902室 法定代表人:李爱军 联系电话:(021)-3866 3732 业务传真:(021)-3866 3732 客服电话:(400)-800-8811 公司网址:www.dwzq.com.cn (127) 名称:齐商银行股份有限公司 注册地址:山东省淄博市周村区金晶大道105号 法定代表人:吴树东 联系电话:(0533)-2788888 业务传真:(0533)-2788888 客服电话:(400)-86-96888 公司网址:www.qibank.com.cn (128) 名称:富国基金管理有限公司 注册地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609A102室 法定代表人:陈慧 联系电话:(021)-68621111 业务传真:(021)-68621111 客服电话:(400)-610191 公司网址:www.fundoc.com.cn (129) 名称:中信证券股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区亮马桥路48号2号楼1101、1102单元 法定代表人:王明 联系电话:(010)-59355941 客服电话:40088-99618 公司网址:www.citics.com (130) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路192号 法定代表人:范一飞 联系电话:(021)-68757231 业务传真:(021)-68757231 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.spdb.com.cn (131) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (132) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (133) 名称:南京安邦基金销售有限公司 注册地址:南京市鼓楼区江浦街道11号 法定代表人:李海 联系电话:(025)-84888888 业务传真:(025)-84888888 客服电话:(400)-620-0020 公司网址:www.abfchina.com (134) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路192号 法定代表人:范一飞 联系电话:(021)-68757231 业务传真:(021)-68757231 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.spdb.com.cn (135) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (136) 名称:天津银行股份有限公司 注册地址:天津市河西区友谊道114号 法定代表人:王金龙 联系电话:(022)-28405310 业务传真:(022)-28405310 客服电话:(400)-620-6620 公司网址:www.tianjinbank.com (137) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区东方路192号 法定代表人:范一飞 联系电话:(021)-68757231 业务传真:(021)-68757231 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.spdb.com.cn (138) 名称:首信证券投资有限责任公司 注册地址:北京市朝阳区东三环北路115号德胜尚城B座1103号 法定代表人:吴涛 联系电话:(010)-83201110 业务传真:(010)-83201110 客服电话:(400)-620-6620 公司网址:www.sxinvest.com.cn (139) 名称:华安证券股份有限公司 注册地址:上海市虹口区四川北路1919号10楼12楼 法定代表人:陈林 联系电话:(021)-68761111 业务传真:(021)-68288888 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.huanan.com.cn (140) 名称:北京肯得瑞财富管理股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区东三环北路115号德胜尚城B座1103号 法定代表人:陈林 联系电话:(010)-85606666 业务传真:(010)-85606666 客服电话:(400)-620-6620 公司网址:www.kendrei.com.cn (141) 名称:上海信证基金销售有限公司 注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68761111 业务传真:(021)-68288888 客服电话:(95228) 公司网址:www.xinzhen.com.cn (142) 名称:上海华信证券有限公司 注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68761111 业务传真:(021)-68288888 客服电话:(95228) 公司网址:www.huaxin.com.cn (143) 名称:弘业证券股份有限公司 注册地址:南京市鼓楼区中南路101号 法定代表人:周树华 联系电话:(025)-52780710 业务传真:(025)-52780710 客服电话:(400)-8615040 公司网址:www.hysec.com.cn (144) 名称:中泰证券股份有限公司 注册地址:济南市经二路纬三路12号 法定代表人:李蔚 联系电话:(0531)-68888888 业务传真:(0531)-68888888 客服电话:(95538) 公司网址:www.zta.com.cn (145) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609A102室 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95558) 公司网址:www.spdb.com.cn (146) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (147) 名称:中融汇金销售有限公司(北京) 注册地址:北京市朝阳区东三环北路115号德胜尚城B座1103号 法定代表人:董耀 联系电话:(010)-68307519 业务传真:(010)-68307519 客服电话:(95511-400)-8888888 公司网址:www.zhongrong.com.cn (148) 名称:上海浦东发展银行股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区世纪大道1609号1609A102室 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95558) 公司网址:www.spdb.com.cn (149) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (150) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (151) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (152) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (153) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (154) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (155) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (156) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (157) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (158) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (159) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (160) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (161) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (162) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (163) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (164) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (165) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (166) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (167) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (168) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (169) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (170) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (171) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (172) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (173) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (174) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (175) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (176) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (177) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (178) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (179) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (180) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (181) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (182) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (183) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (184) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (185) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (186) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (187) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (188) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (189) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (190) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (191) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (192) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (193) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (194) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (195) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (196) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (197) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (198) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (199) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn (200) 名称:上海农村商业银行股份有限公司 注册地址:上海市银城中路168号 法定代表人:李蔚 联系电话:(021)-68757888 业务传真:(021)-68761111 客服电话:(95228) 公司网址:www.urbc.com.cn	
---	--

4. 报告期内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	地方政府债	139,899,000.00	5.56			
4	资产支持证券	139,899,000.00	5.56			
5	企业债	18,562,667.60	0.75			
6	中期票据	110,242,000.00	4.39			
7	可转债(可交换债)	27,361,863.30	1.09			
8	其他	758,100,000.00	29.31			
9	其他	-	-			
10	合计	1,394,447,930.90	55.46			
5. 报告期内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	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	111708142 17年国债FC162	2,000,000	197,760,000.00	7.87		
2	04164607 16国债FC191	1,100,000	110,242,000.00	4.39		
3	130212 13国债FC191	1,000,000	109,790,000.00	4.05		
4	140278 14国债FC191	1,000,000	99,990,000.00	3.86		
5	11170920 17国债FC2250	1,000,000	98,910,000.00	3.03		
6. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产投资明细						
本基金本报告期末持有资产支持证券。						
7. 报告期内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						
本基金本报告期末持有贵金属。						
8. 报告期内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						
本基金本报告期末持有权证。						
9. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货合约投资明细						
(1) 本基金本报告期末未有股指期货。						
(2) 本基金本报告期末未有股指期货交易。						
10. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货合约投资明细						
(1) 本基金本报告期末未有国债期货。						
(2) 本基金本报告期末未有国债期货交易。						
11. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细						
本基金本报告期末持有股票。						
12. 报告期内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有权证。						
13. 其他各项资产						
序号	名称	金额(元)				
1	存出保证金	37,076.34				
2	应收证券清算款	4,202,746.38				
3	应收股利	-				
4	应收利息	17,093,479.27				
5	其他应收款	12,899,014.00				
6	其他流动资产	-				
7	待摊费用	-				
8	其他	-				
9	合计	21,346,192.03				
14. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货合约投资明细						
本基金本报告期末未有股指期货。						
15. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货合约投资明细						
本基金本报告期末未有国债期货。						
16. 报告期内公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细						
序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	高送转情况	
1	002859	富祥新材	466,148.00	0.02	高送转	
2	602686	福晶科技	398,322.00	0.02	高送转	
第一部分 基金业绩						
本基金业绩比较基准: 沪深300指数收益率*90%+中债综合指数收益率*10%						
期间	净值增长率	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率	①-②	②-③
2016.2.3	1.01%	0.05%	2.34%	0.00%	-1.44%	0.05%
2017.1.31	2.37%	0.00%	1.38%	0.00%	-0.99%	0.00%
自基金合同生效至今	3.56%	0.06%	3.92%	0.00%	-0.42%	0.06%
注: ①业绩比较基准: 沪深300指数收益率*90%+中债综合指数收益率*10%						
②业绩比较基准: 沪深300指数收益率*90%+中债综合指数收益率*10%						
③业绩比较基准: 沪深300指数收益率*90%+中债综合指数收益率*10%						
7. 本基金建仓以来以基金合同生效日为基准, 截至本报告期末, 本基金资产配置比例符合基金合同有关规定。						
第二部分 基金费用						
一、基金费用的种类						
1. 基金管理人的管理费;						
2. 基金托管人的托管费;						
3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;						
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费;						
5. 基金份额持有人大会费用;						
6. 基金的销售费用;						
7. 基金的银行汇划费用;						
8. 证券账户开户费用/银行账户开户费用;						
9. 按照国家有关规定和基金合同约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。						
本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出金额, 先从基金财产中支付, 不足部分由基金管理人承担, 与基金财产无关。						
二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式						
1. 基金管理人的管理费						
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%费率计提。管理费的计算方法如下:						
H= E×1.20%÷当年天数						
H为每日应计提的基金管理费						
E为前一日的基金资产净值						
若本基金到期后, 本基金不符合保本基金存续条件, 转换为“发安灵活配置混合型证券投资基金”, 则管理费按前一日基金资产净值的1.50%费率计提。						
2. 基金托管人的托管费						
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%费率计提。计算方法如下:						
H= E×0.25%÷当年天数						
H为每日应计提的基金托管费						
E为前一日的基金资产净值						
若本基金到期后, 本基金不符合保本基金存续条件, 转换为“发安灵活配置混合型证券投资基金”, 则托管费按前一日基金资产净值的0.30%费率计提。						
3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用						
本基金的信息披露费, 包括基金募集期间的信息披露费、基金份额持有人大会费用、基金合同生效前的信息披露费, 基金份额持有人大会费用, 基金合同生效后的信息披露费, 基金年度报告、半年度报告、季度报告、中期报告、基金净值公告、基金临时公告等费用, 均由基金管理人承担, 与基金财产无关。						
三、不同类别基金份额的费用						
下列费用列入基金费用:						
1. 基金管理人的管理费;						
2. 基金托管人的托管费;						
3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;						
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费;						
5. 基金份额持有人大会费用;						
6. 基金的销售费用;						
7. 基金的银行汇划费用;						
8. 证券账户开户费用/银行账户开户费用;						
9. 按照国家有关规定和基金合同约定, 可以在基金财产中列支的其他费用。						
本基金终止清算时所发生费用, 按实际支出金额, 先从基金财产中支付, 不足部分由基金管理人承担, 与基金财产无关。						
三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式						
1. 基金管理人的管理费						
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%费率计提。管理费的计算方法如下:						
H= E×1.20%÷当年天数						
H为每日应计提的基金管理费						
E为前一日的基金资产净值						
若本基金到期后, 本基金不符合保本基金存续条件, 转换为“发安灵活配置混合型证券投资基金”, 则管理费按前一日基金资产净值的1.50%费率计提。						
2. 基金托管人的托管费						
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%费率计提。计算方法如下:						
H= E×0.25%÷当年天数						
H为每日应计提的基金托管费						
E为前一日的基金资产净值						
若本基金到期后, 本基金不符合保本基金存续条件, 转换为“发安灵活配置混合型证券投资基金”, 则托管费按前一日基金资产净值的0.30%费率计提。						
3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用						
本基金的信息披露费, 包括基金募集期间的信息披露费、基金份额持有人大会费用、基金合同生效前的信息披露费, 基金份额持有人大会费用, 基金合同生效后的信息披露费, 基金年度报告、半年度报告、季度报告、中期报告、基金净值公告、基金临时公告等费用, 均由基金管理人承担, 与基金财产无关。						
四、费用调整						
基金管理人和基金托管人协商一致, 可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率, 且无需召开基金份额持有人大会。						
调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率, 无需召开基金份额持有人大会。						
基金管理人必须于新的费率实施前2个工作日之前至少在一种全国性公开发行证券的全国性报刊上刊登公告。						
第四部分 风险提示						
一、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, 投资者投资本基金可能面临多种风险, 投资本基金可能						