



国投瑞银双债增利债券型证券投资基金招募说明书摘要

(2013年11月更新)

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

【重要提示】
本基金经中国证监会2011年1月21日证监许可[2011]127号文核准募集,本基金基金合同于2011年3月29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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值或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。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金份额时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资人自身的风险承受能力,并正确认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持份额享有基金的收益,但同时也需要承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金净值波动等风险。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决定后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资人自行承担。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%,其中,可转债、信用债合计投资比例不低于固定收益类资产的80%;本基金投资于非固定收益类资产不超过基金资产净值的20%。本基金封闭期结束后转为开放式,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金包括A、C两类份额。募集期发售A类基金份额,该类基金份额在基金合同生效后3年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易;封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF);封闭期结束后转为开放式后,投资人可以选择申购A类或C类基金份额。

本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型股票型基金。

基金管理人管理的其他基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日期为2013年9月29日,其中投资组合报告与基金业绩截止日期为2013年6月30日。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司于2013年10月11日对本招募说明书(2013年11月更新)进行了复核。

一、基金管理人
名称:国投瑞银基金管理有限公司
英文名称:UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD
住所:上海市虹口区东大名路638号7层
办公地址:深圳市福田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人:钱军
设立日期:2000年6月1日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2002]25号
组织形式:有限责任公司
注册资本:壹亿元人民币
存续期限:持续经营
联系人:杨雪
客服电话:400-880-0868
传真:0755-82904048
股权结构:
股东名称 持股比例
国投信托有限公司 51%
瑞士银行股份有限公司(UBS AG) 49%
合计 100%

二、主要人员情况
1. 董事会成员
钱军先生,董事长,中国籍,硕士,现任国家开发投资公司党组成员、副总裁,国投信托有限公司董事长。曾任国家开发投资公司总助助理,中国包钢集团公司党组书记、总经理,国投财务有限公司董事长,国投资产管理公司总经理,安徽省安中市市委副书记,兴业基金投资有限公司董事,国家开发投资公司金融部总经理、经营部部长,国投信托有限公司总经理,国家开发投资公司机电轻纺事业部总经理,国家机电轻纺投资公司工程师、副处长,国家计委干部、主任科员。
凌新南先生,董事,中国籍,硕士,高级经济师。现任瑞银环球 香港 环球资产管理公司董事总经理,中国区主席。曾任华夏基金管理有限责任公司董事长、北京证券有限公司董事长、华夏证券有限公司执行副总裁,中国钢铁工业集团总公司总助理,中国冶金进出口总公司总助理,北京国际信托投资公司业务部副经理。
王瑞华女士,董事,中国籍,硕士,高级经济师。现任国投信托有限公司副经理兼董事,北京国信资产管理有限责任公司副总经理兼董事兼秘书,国投信托有限公司资产管理部总经理,国家机电轻纺投资公司工程师、副处长,国家计委干部、主任科员。

凌新南先生,董事,中国籍,硕士,高级经济师。现任瑞银环球 香港 环球资产管理公司董事总经理,中国区主席。曾任华夏基金管理有限责任公司董事长、北京证券有限公司董事长、华夏证券有限公司执行副总裁,中国钢铁工业集团总公司总助理,中国冶金进出口总公司总助理,北京国际信托投资公司业务部副经理。
王瑞华女士,董事,中国籍,硕士,高级经济师。现任国投信托有限公司副经理兼董事,北京国信资产管理有限责任公司副总经理兼董事兼秘书,国投信托有限公司资产管理部总经理,国家机电轻纺投资公司工程师、副处长,国家计委干部、主任科员。

董志成先生,董事,中国香港籍,美国 sheffield 大学学士,现任瑞银环球资产管理公司中国区董事总经理。曾任瑞银环球资产管理公司中国区业务经理、执行董事,瑞银环球资产管理对冲基金亚太区首席运营官,瑞银环球资产管理合规总监,香港瑞银资产管理部IT主管,国投瑞银基金管理有限公司的代总经理和首席运营官,美林投资经理人公司亚太区首席运营官,美国国际集团亚太地区的金融及营运领域担任多个重要职务。

李树平先生,独立董事,中国籍,金融学硕士。现任当代金融杂志主编,中国银行独立董事,中航证券有限公司独立董事。曾任安信证券评估中心董事长,中国证券报理论版主编,中国银行业协会培训中心助教。
方文辉先生,独立董事,中国籍,法学学士,现任北京诚同达律师事务所高级合伙人、律师,主要从事公司业务及IPO、上市公司再融资及重大重组、证券诉讼基金及私募基金的法律、投资等业务,兼任中国中化集团公司独立董事。曾任广东广东南方律师事务所、北京京新律师事务所。
龙芳先生,独立董事,中国籍,硕士。现任北京海同投资咨询有限公司董事长、中央财经大学会计系副教授,兼任北汽汽车股份有限公司北京北辰实业股份有限公司独立董事。曾任华夏基金管理有限责任公司独立董事,兼任华联国际会计师事务所分部担任审计和财务分析工作。

2. 监事会成员
叶华英先生,监事长,中国香港籍,澳大利亚 University of Technology, Western Australia 学士,现任瑞银环球资产管理公司大区政府总监、董事总经理。曾任瑞银环球资产管理财务部执行董事、财务总监,并曾在瑞银环球银行担任等机构担任重要职务。
展展先生,监事,中国籍,硕士。现任国投信托有限公司财务总监兼负责人。曾任国家开发投资公司战略发展处第一项目经理助理,国投信托有限公司信托资产运营部和信托资产管理部项目经理。

黄欣女士,监事,中国籍,硕士,经济师。现任瑞银环球基金管理有限公司运营稽核部副经理。曾任国投瑞银基金管理有限公司运营稽核部总监,中融基金管理有限公司董事会秘书兼运营稽核部总监,河北证券有限责任公司资产管理部副经理,中国旅游信托投资有限公司深圳证券营业部总经理,建行辽宁省信托投资公司深圳证券营业部副经理等。

三、基金管理人董事、监事及高级管理人员
刘敬宏先生,总经理,中国籍,金融学学士,中国注册会计师协会和特许公认会计师公会(ACCA)会员。曾任北京建银集团总会计师,柏德普 BDO 阮庆芳国际会计师事务所合伙人,中国证券投资基金业协会基金部科员,同时兼任基金管理人运营稽核部负责人、督察长,国投瑞银基金管理有限公司副总经理。
盛威先生,副总经理,中国籍,美国哥伦比亚大学国际关系学硕士。曾任国投瑞银北京投行项目负责人,万邦基金有限公司金融工程部总监,总经理助理兼市场总监。

王鹏先生,副总经理,中国籍,北航航空工程学士、工学硕士。曾任内蒙古蒙自集团交通规划设计院,内蒙古自治区交通规划局规划室,北京拓宇交通通用设施有限公司财务经理,利安达信隆会计师事务所项目助理,国投信托有限公司财务、信托资产运营管理部经理。

包丽雯女士,副总经理,中国籍,美国哥伦比亚大学硕士。曾任贝莱德资产管理公司资产管理核算部、共同基金业务主管,银华基金管理有限公司战略发展部总监,国投瑞银基金管理有限公司业务及业务拓展部总监、总经理助理、督察长。

刘凯先生,督察长,中国籍,复旦大学工商管理学硕士。曾任荣泰集团资产管理项目经理,君安证券部门南营业部研究员,平安证券蛇口营业部助理副经理,招商基金管理有限公司客户服务部总监,国投瑞银基金管理有限公司市场服务部总监、总经理助理。

四、基金基金经理
陈翔刚先生,固定收益组总监,中国籍,香港中文大学金融财务工商管理硕士,16年证券从业经历。曾任职于平安保险资产管理公司,华安财产保险股份有限公司,从事保险资产管理、债券投资工作。2008年5月加入国投瑞银基金管理有限公司,先后任职于基金投资部、专户投资部,从事债券投资管理及相关研究工作。2012年9月15日起担任国投瑞银双债增利债券型证券投资基金、国投瑞银增利债券型证券投资基金及国投瑞银货币市场基金基金经理。2013年5月14日起兼任国投瑞银中高等债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理:
韩海平先生,2011年3月29日至2012年9月14日。
5. 投资决策委员会成员的姓名、职务
投资决策委员会召集人:刘新勇先生,总经理助理
C 投资决策委员会成员:
孟宪先生:基金投资部副总监,基金经理
陈翔刚先生:固定收益组总监,基金经理
何明女士:研究部副总监

LU RONGQIANG 先生:量化投资组总监,基金经理
杨俊先生:交易部总监
刘文杰先生:专户投资部总监,投资经理
6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人
(一)基金托管人概况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟亿伍仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:010-6159 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民银行”于1954年成立,1996年易名“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月正式成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行股票代码:9399于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,019,777,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,比上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点,净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.07%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖全球14个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家,拥有信托公司、租赁公司、信达信托、建行信人、中德住房储蓄银行等子公司,为客户id提供一体化金融金融服务能力进一步增强。

2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》杂志500强排名位列第23,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要权威机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、财富管理、科技应用、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设在北京总部,下设总行、基金市场、证券保险业务市场部、理财信托部、信托部、FQI托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外业务核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海股份中心12个职能部门、团队,现有员工22.5万人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

三、主要人员情况
基金管理人投资管理部门总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行,中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资管理部业务副经理,曾就职于中国建设银行南京分行,中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张红军,投资管理部业务副经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、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。

郑绍平,投资管理部业务副经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,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,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金账户、QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年6月30日,中国建设银行已托管311只证券投资基金,建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”,在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”,并荣获和讯网2011年度和2012年度中国最佳资产托管银行奖,和国内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。

C 基金托管人的内部控制制度
1. 内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监查,确保业务的安全稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2. 内部控制组织结构
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行监督检查。投资管理部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3. 内部控制制度及措施
投资管理部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区实行专人负责,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

C 基金托管人对基金管理人运用基金资产监督的方法和程序
1. 监督方法
依照《基金法》及其配套法规和《基金合同》约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督系统”,严格按照现行法律法规以及《基金合同》规定,对基金管理人运用基金资产的投资比例、投资范围、投资情况等项进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令,基金管理人向各基金资产的托管行及开户银行进行核查监督。

2. 监督流程
1. 每日工作日报时通过基金监督系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3. 根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性、风险控制显著性等方面进行分析,报送中国证监会。
4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构
(一)基金销售代理机构
1. 场外发售机构
①直销机构:国投瑞银基金管理有限公司直销中心
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人:钱军
电话:0755-83575993 83575992
传真:0755-82904048 82904047
联系人:曹美丽、杨雪
客服电话:400-880-0868
网站:www.ubsidc.com

②代销机构:中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安金融中心)
法定代表人:王洪章
电话:010-67596084
传真:010-67625654
联系人:李娜
客服电话:95533
网站:www.ccb.com

其他代销机构情况详见本基金《发售公告》。
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
2. 场内销售机构
本基金的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(包括:国泰君安、广发证券、国信证券、招商证券、中信证券、海通证券、申银万国、西南证券、华泰证券、大同证券、华民证券、山西证券、长江证券、中财证券通融、光大证券、兴业证券、华泰证券、渤海证券、中信金通证券、广发证券、国元证券、湘财证券、东吴证券、东方证券、光大证券、上海证券、华泰证券、浙商证券、平安证券、华安证券、东北证券、南京证券、长城证券、国海证券、财富证券、东吴证券、中原证券、国都证券、恒泰证券、中国国际证券、齐鲁证券、华创证券、国盛证券、新时代证券、华林证券、中银证券、中农证券、宏源证券、海通证券、世纪证券、民生证券、西南证券、西藏证券、华泰证券、华泰证券、中航证券、第一创业证券、中德证券、财通证券、安信证券、银河证券、华泰证券、瑞银证券、国金证券、中航证券、中川证券、红塔证券、日信证券、西藏证券、方正证券、联讯证券、方正证券、华泰证券、民族证券、华宝证券、厦门证券、爱建证券、美大证券等)。

C 注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:010-59378856
传真:010-58898907
联系人:崔嵬
C 出具法律意见书的律师事务所
名称:上海泰泰律师事务所
住所:上海市浦东南路河南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:021-81155028
传真:021-81150398
经办律师:廖海、刘佳
联系人:廖海
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海湖南路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:021-23238888
传真:021-23238880
经办注册会计师:薛克、张瑞文

四、基金的投资
基金管理人:国投瑞银双债增利债券型证券投资基金
本基金类型:债券型。
基金运作方式:契约型。本基金包括A、C两类份额。募集期仅发售A类基金份额,该类基金份额在基金合同生效后3年内封闭运作,在深圳证券交易所上市交易;封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF);封闭期结束后转为开放式后,本基金包括A、C两类份额。

六、基金的投资目标
在追求基金资产稳定增值、有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向
本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的可转债(含可分离交易可转债)、信用债(即企业债、公司债、次级债、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、金融债等非常规信用的固定收益类金融工具)、国债、央行票据、债券回购、银行存款、股票(创业板和中小板)、权证等金融工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种。

本基金可以参与一级市场 创业板和中小板IPO 增发新股或增发新股的申购,并持有因可转债转股所形成的股票,因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规和中国证监会允许投资的非固定收益类资产。本基金不买入二级市场中的权证、权证。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产净值的80%,其中,可转债、信用债合计投资比例不低于固定收益类资产的80%;本基金投资于非固定收益类资产不超过基金资产净值的20%。本基金封闭期结束后转为开放式,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略
本基金采取稳健灵活的投资策略,主要通过对可转债、信用债等固定收益类金融工具的主动管理,力求在有效控制风险的前提下,获得基金资产的稳定增值,并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益预测,适度参与一级市场首发新股和增发新股的申购,力求提高基金总体收益率。

九、基金的投资组合
基金资产配置
本基金采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券组合配置,并管理组合风险。
图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图1.债券组合构建流程

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

图2.均衡收益率曲线图

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
8.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。
9.投资组合报告附注
① 本基金投资的前十名证券发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也未受到公开谴责、处罚。
② 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。
③ 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号 名称 金额
1 存出保证金 151,627.86
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 31,218,139.76
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 31,369,767.62

④ 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 110011 歌华转债 64,156,659.00 5.04
2 113001 中行转债 12,428,656.50 0.98

⑤ 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票资产。
⑥ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑦ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑧ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑨ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑩ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑪ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑫ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑬ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑭ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑮ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑯ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑰ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑱ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑲ 本基金本报告期末未持有股票资产。
⑳ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉑ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉒ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉓ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉔ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉕ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉖ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉗ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉘ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉙ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉚ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉛ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉜ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉝ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉞ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㉟ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊱ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊲ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊳ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊴ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊵ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊶ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊷ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊸ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊹ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊺ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊻ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊼ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊽ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊾ 本基金本报告期末未持有股票资产。
㊿ 本基金本报告期末未持有股票资产。
一、基金的投资
1. 基金的投资目标
2. 基金的投资范围
3. 基金的投资对象
4. 基金的投资策略
5. 基金的投资组合
6. 基金的投资风险
7. 基金的投资业绩
8. 基金的投资费用
9. 基金的投资税收
10. 基金的投资其他

二、基金的费用
(一)与基金运作有关的费用
1. 与基金运作有关的费用
2. 基金管理人管理费
3. 基金托管人托管费
4. 销售服务费
5. 基金资产净值变动费用
6. 基金合同生效后的信息披露费用
7. 基金合同终止时的费用
8. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
9. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
10. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
11. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
12. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
13. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
14. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
15. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
16. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
17. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
18. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
19. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
20. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
21. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
22. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
23. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
24. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
25. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
26. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
27. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
28. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
29. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
30. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
31. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
32. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
33. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
34. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
35. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
36. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
37. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
38. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
39. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
40. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
41. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
42. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
43. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
44. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
45. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
46. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
47. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
48. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
49. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
50. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
51. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
52. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
53. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
54. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
55. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
56. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
57. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
58. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
59. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
60. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
61. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
62. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
63. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
64. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
65. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
66. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
67. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
68. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
69. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
70. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
71. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
72. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
73. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费
74. 基金合同生效后与基金有关的