

## 中欧基金管理有限公司中欧兴利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:中欧基金管理有限公司  
基金托管人:兴业银行股份有限公司  
二〇二〇年七月

本基金经2015年7月24日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予中欧兴利债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1787号文)准予募集注册。本基金经理于2015年9月25日正式生效。

基金管理人保证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保证。

基金管理人保证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保证。

基金管理人保证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保证。

基金管理人保证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保证。

序号	基金名称	出资额(人民币万元)	出资比例
1	Unione di Banche Italiane S.p.A.	5,500	25.0000%
2	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
3	北京尚敬投资有限公司	4,400	20.0000%
4	上海融亿投资管理合伙企业(有限合伙)	4,400	20.0000%
5	谢玉明	1,100	5.0000%
6	万盛基业投资有限责任公司	726	3.3000%
7	周玉雄	328.35	1.4925%
8	卢纯青	163.8340	0.7447%
9	于洁	163.8340	0.7447%
10	赵国英	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	卞筱云	92.4660	0.4209%
14	魏博	87.7580	0.3989%
15	郑苏丹	87.7580	0.3989%
16	曲征	87.7580	0.3989%
17	黎亿海	64.3720	0.2926%
合计		22,000	100%

二、主要人员情况  
1. 基金管理人董事会成员  
谢玉明先生,清华大学经济学管理本科、硕士,美国杜兰大学 MBA,中欧基金管理有限公司董事长,上海盛业基金合伙企业董事,国寿证券投资有限公司独立董事,天合光能股份有限公司董事。曾任君安证券助理、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副经理兼基金副经理,富国基金管理有限公司副经理。  
Marco D'Este 先生,意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布西尼亚农业信贷银行(CAB)国际部总监,曾在意大利信贷银行(Credito Italiano, 原名:联合信贷银行 Uncredito)圣雷莫分行、米兰分行、伦敦分行、纽约分行、东京分行(财务负责人)及米兰总部工作。  
朱腾骞先生,中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都景瑞投资有限公司副经理。曾任联想集团董事、中国工商银行总行,国都证券投资有限公司计划财务部高级经理、副经理、投行业务董事及内核小组副组长。  
刘建群先生,北京大学法学学士,法学硕士,美国圣路易斯大学国际商学院工商管理博士。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京理工大学教师,中国证券监督管理委员会基金监管部副部长,上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson 先生,英国籍。现任 IFM (亚洲)有限公司创办者及合伙人,The Red Flag Group 非执行董事,英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员,中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永(中国香港特别行政区及美国伯明翰、伦敦)审计经理、副经理,赛贝斯股份有限公司亚洲区财务总监。

郭勇先生,中国籍。现任北京大学法学院教授,博士生导师,中欧基金管理有限公司独立董事。法学博士。曾任经济科学博士,后,留德读经济学,中国境内法学专业副教授。历任北京大学法学院讲师、副教授,美国密歇根大学法学院客座教授,毕业于北京大学、美国南加利福尼亚大学、哈佛大学法学院。

戴国强先生,中国籍。上海财经大学金融专业硕士,复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司董事,国寿证券投资有限公司独立董事,实业国际信托有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院副院长、院长、党委书记、上海财经大学 MBA 学院院长兼书记、上海财经大学商学院书记兼副院长。

二、基金管理人监事会成员  
唐步先生,中欧基金管理有限公司监事会主席、中欧盛资产管理(上海)有限公司董事长,中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理,上海证券交易公司副总经理、监察部总监,大通证券股份有限公司副总经理,国都证券股份有限公司副经理、总经理,中欧基金管理有限公司董事。

廖海先生,中欧基金管理有限公司监事,上海瀛泰律师事务所合伙人,中国籍。武汉大学法学博士,复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市罗湖区实业总公司法律顾问,广东烟草律师事务所合伙人,美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师,北京市中伦律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士,中国籍。加拿大注册会计师,金融学硕士,15年以上基金从业经验。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《证券投资基金募集管理办法》,担任中欧兴利债券型证券投资基金基金经理。曾任中国华信集团人力资源部主管,现任中欧基金管理有限公司中国华商基金运营部副经理。

李琛女士,中国籍。现任中欧基金管理有限公司副经理,中国籍。清华大学计算机专业硕士。历任大连证券上海福山路营业部系统管理员,大通证券公司基金客户服务部主管。

三、基金管理人高级管理人员  
谢玉明先生,中欧基金管理有限公司董事长,中国籍。简历同上。  
刘建群先生,中欧基金管理有限公司总经理,中国籍。简历同上。

顾伟先生,中欧基金管理有限公司分管投资副总经理、固收投资决策委员会主席,中国籍。上海财经大学金融学硕士,19年以上证券及基金从业经验。历任平安集团资产管理中心债券部研究员、研究主管,平安资产管理有限责任公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理。

许效先生,中欧基金管理有限公司分管投资副总经理、权益投资决策委员会、投资运营部副经理、中国籍。加拿大注册会计师,金融学硕士,15年以上基金从业经验。历任北京毕马威会计师事务所审计,中信基金资产管理(天津)有限公司研究员、银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

卢琦女士,中国籍。现任中欧基金管理有限公司督察长,中国籍。中国人民大学金融学专业,19年以上基金从业经验。历任西安基金管理有限公司北京分公司销售经理,嘉实基金管理有限公司机构管理部副总监,富国基金管理有限公司副总经理。

下颢云女士,中欧基金管理有限公司督察长,中国籍。中国人民大学注册会计师专业,12年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理,银华基金管理有限公司投资管理部副总监,中欧基金管理有限公司风控总监。

四、本基金经理  
(1) 基金基金经理  
姓名 洪慧梅 性别 女  
国籍 中国 毕业院校及专业 同济大学金融学

姓名 洪慧梅 性别 女  
国籍 中国 毕业院校及专业 同济大学金融学

其他公司任职  
平安资产管理有限责任公司金融销售交易员(2007.02-2009.04),汇丰人壽保險股份有限公司債券交易員(2009.05-2011.04),浙商银行證券有限公司基金經理(2011.05-2016.03),平安養老保險股份有限公司基金經理(2016.04-2019.06)

本公司担任  
无  
本公司管理  
基金經理

序号	产品名称	起任日期	离任日期
1	中欧盈和5年定期开放债券型证券投资基金	2019年08月16日	
2	中欧聚财货币基金	2019年08月16日	
3	中欧货币市场基金	2019年08月16日	
4	中欧信用增利增强型证券投资基金(LOF)	2019年08月16日	
5	中欧天颐地债债券型证券投资基金	2019年08月16日	
6	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2019年10月10日	
7	中欧泓源债券型证券投资基金	2020年04月30日	
8	中欧广安一年定期开放债券型证券投资基金	2020年04月30日	
9	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2019年05月25日	
10	中欧弘安定期开放债券型证券投资基金	2020年07月23日	
11	中欧兴利债券型证券投资基金	2020年07月23日	
12	中欧弘安一年定期开放债券型证券投资基金	2020年07月23日	

姓名 赵国英 性别 女  
国籍 中国 毕业院校及专业 清华五道口金融学院金融学硕士

其他公司任职  
天安保險有限公司債券交易員(2004.07-2005.05),興業銀行資金營運中心債券交易員(2005.05-2009.12),美國銀行上海分行全球金融市場部副總監(2009.12-2015.04)

本公司担任  
投資經理  
本公司管理  
基金經理

序号	产品名称	起任日期	离任日期
1	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	
2	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	2018年11月22日
3	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	2019年02月11日
4	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金	2018年08月21日	
5	中欧信用增利增强型证券投资基金(LOF)	2018年08月21日	2019年08月26日
6	中欧兴利债券型证券投资基金	2018年08月21日	
7	中欧瑞福多策略定期开放债券型证券投资基金(LOF)	2018年08月21日	
8	中欧兴利债券型证券投资基金	2018年10月30日	
9	中欧盈和5年定期开放债券型证券投资基金	2019年07月11日	
10	中欧兴利债券型证券投资基金	2019年12月31日	

(2) 历任基金经理  
姓名 朱锐杰 起任日期 2017年04月07日 离任日期 2018年08月21日  
姓名 刘德文 起任日期 2015年09月25日 离任日期 2017年06月27日

基金管理人投资决策委员会成员  
投资决策委员会是公司进行基金投资管理的高级投资决策机构,由总经理刘建群、副总经理兼策略部负责人顾伟、副总经理兼权益总监、策略部负责人卢纯青、策略部负责人周蔚文、周文俊、周玉雄、刁羽、黄陈、陈超、安文、曲征、曹晋长、王培、王健、信用评估部总监张勇、风险管理部总监孙华、风控、交易室总监陆正芳组成,其中总经理刘建群任投资决策委员会主任。

基金托管人  
一、基金托管人基本情况  
1. 基本情况  
名称: 兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)  
注册地址: 福州市湖东路154号  
办公地址: 上海市江宁路168号  
法定代表人: 高建平  
成立时间: 1988年8月22日  
注册资本: 207.74亿元人民币  
存续期间: 持续经营  
基金托管业务资格及文号: 中国证监会证监基金字[2005]74号  
托管部门负责人: 吴玉婷  
电话: 021-52629999  
网址: 021-62159217

二、发展概况及财务状况  
兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166)。兴业银行以426.21亿美元资产名列全球银行第28位,按总资产排名第30位,跻身全球银行30强。按美国《财富》杂志“世界500强”最新榜单,兴业银行以426.21亿美元资产名列全球第230位。同时,过去一年在中国内外权威机构的各项评比中,先后获得“亚洲卓越商业银行”、“年度最佳股份制银行”、“中国最佳零售银行”等多项殊荣。

三、托管业务的内部风险控制  
1. 内部控制目标  
严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和行内管理规定,确保基金资产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。  
2. 内部控制组织架构  
基金管理人内控包括资产、负债、运营、风险管理、法律与合规、信息技术、财务、人力资源、计划、人力资源部等部门。资产、运营、法律与合规、信息技术、财务、人力资源等部门内设专职、专业的稽核监察处,配备了专职内控合规人员负责资产、运营、法律与合规的内控具体工作,具有独立行使稽核稽核工作职责和权力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

四、基金托管人的内部控制  
(一) 全面性原则: 风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节,风险控制责任落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。  
(二) 独立性原则: 资产托管部设立独立的稽核监察处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责资产托管业务风险控制工作进行指导和监督。  
(三) 相互制约原则: 各处室在内部组织架构的设置上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡关系。  
(四) 定量和定性相结合原则: 建立完善的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。  
(五) 防火墙原则: 托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。  
(六) 有效性原则: 内部控制措施同所处的环境相适应,以合理的成本实现内部控制目标,内部控制制度应当具有前瞻性,并能根据国家政策、法律及经营管理的需要,适时进行相应调整和更新;内部控制制度具有权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。  
(七) 审慎性原则: 内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设。  
(八) 责任追究原则: 各业务环节的负责人必须有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的管理人员等进行问责。

五、内部控制制度及措施  
(1) 制度建设: 建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。  
(2) 建立健全的组织管理架构: 前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。  
(3) 风险识别与评估: 稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实

施风险控制措施。  
(4) 相对独立的业务操作空间: 业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员独立: 业务操作人员须接受过职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。  
(6) 应急预案: 制定完善的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

五、基金托管人对基金管理人运用基金资产的投资方法和程序  
基金托管人负有对基金管理人的投资运作进行监督的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项,对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有关基金资产的投资方法违反法律法规的有关规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能按期纠正,基金托管人应及时报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关基金资产的重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时,通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。  
基金托管人发现基金管理人指令违反法律法规、行政法和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。  
第三部分 相关服务机构  
一、基金份额发售机构  
1. 直销机构  
名称: 中欧基金管理有限公司  
住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层  
办公地址: 上海市虹口区公平路18号8栋-嘉盛大厦7层  
法定代表人: 谢玉明  
联系人: 袁继博  
电话: 021-68609602  
传真: 021-68609601  
客服热线: 021-68609700, 400-700-9700(免长途话费)  
网址: www.zofund.com

2. 其他销售机构  
名称: 国都证券股份有限公司  
住所: 北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层  
办公地址: 北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层  
法定代表人: 王少华  
客服热线: 400-818-8118  
网址: www.guodu.com

基金管理人可以根据情况变化,增加或者减少销售机构,并在基金管理人网站公告。销售机构可以根据情况变化,增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异,具体请咨询各销售机构。

名称: 中欧基金管理有限公司  
住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号5层  
办公地址: 上海市虹口区公平路18号8栋-嘉盛大厦7层  
法定代表人: 谢玉明  
总经理: 刘建群  
成立日期: 2006年6月7日  
电话: 021-68609600  
传真: 021-68609601  
联系人: 杨敏

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: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人: 俞卫锋  
经办律师: 黎明、陆奇  
电话: 021-31358666  
传真: 021-31358660

四、审计基金财产的会计师事务所  
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所: 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  
办公地址: 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: 毛贻敏  
电话: 010-58153000  
传真: 010-85188298  
联系人: 徐艳  
经办会计师: 徐艳、印地冉

第四部分 基金名称  
中欧兴利债券型证券投资基金  
基金简称: 基金名称  
契约型 开放式  
基金的投资目标  
本基金的投资范围具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、央行票据、次级债,可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。  
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:  
本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。  
第八部分 基金的投资策略  
(一)固定收益投资策略  
本基金采取久期策略、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建投资组合。  
(二) 类属配置  
类属配置指投资组合中各债券品种间的配置,包括国债在国债、央行票据、金融债、企业债、可转债债券等债券品种间的分布,债券资产浮动利率债券和固定利率债券间的分布。  
(三) 个券选择  
个券选择指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限下的债券品种的个券。  
(四) 资产支持证券投资策略  
本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察,分析资产支持证券的条款,预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

第三部分 基金的费用与税收  
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、律师费和诉讼费;  
5. 基金份额持有人大会费用;  
6. 基金的销售交易费用;  
7. 基金的银行汇划费用;  
8. 基金的相关账户的开户及维护费用;  
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。  
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0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:  
H=E×0.30%÷当年天数  
H为每日应计提的基金管理费  
E为前一日基金资产净值  
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。  
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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
H=E×0.10%÷当年天数  
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日基金资产净值  
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。  
上述“基金费用”指基金合同中“3-9项费用”,根据相关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。  
三、不列入基金费用的项目  
下列费用不列入基金费用:  
1. 基金管理人和基金托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. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;  
3. 基金合同生效前的相关费用;  
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。  
四、基金收益  
本基金运作过程中涉及的各项主体,其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。  
第十四部分 对招募说明书更新部分的说明  
本招募说明书将根据《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作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定,并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的经营管理活动,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:  
(一)更新“第二部分 基金管理人”部分中的相关内容  
本基金本次更新主要涉及基金基金经理变更,并已对相关内容做出了更新。

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债	52,310,000.00	1.06
2	央行票据	-	-
3	金融债	714,208,000.00	14.45
4	其中:政策性金融债	663,363,000.00	13.42
5	企业债	2,619,649,137.80	52.99
6	企业短期融资券	633,731,000.00	12.82
7	中期票据	1,482,614,500.00	29.99
8	可转换债(可交换债)	-	-
9	同业资产	291,620,000.00	5.90
10	合计	5,794,132,637.80	117.20

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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1888004	18铁道01	3,800,000	401,546,000.00	8.12
2	170206	17国债06	2,200,000	224,290,000.00	4.54
3	11814203	18江苏银行CD203	2,000,000	194,960,000.00	3.94
4	112520	17广发01	1,748,000	176,443,120.00	3.57
5	101800625	18发企MTN006BC	1,500,000	153,540,000.00	3.11

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789149	17开元2B	390,000	39,347,100.00	0.80
2	142151	PR-远东4A	2,000,000	38,604,046.28	0.78
3	119277	15宁波07	200,000	19,910,016.96	0.40
4	119274	15宁波04	200,000	19,754,186.30	0.40
5	119275	15宁波05	200,000	19,694,010.96	0.40
6	119276	15宁波06	200,000	19,612,016.96	0.40
7	1789078	17福元1B	150,000	5,217,000.00	0.11

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. 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
股指期货不属于本基金的的投资范围,故不适用。  
9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
股指期货不属于本基金的的投资范围,故不适用。  
9.3 本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资策略  
国债期货不属于本基金的的投资范围,故不适用。  
10.2 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
国债期货不属于本基金的的投资范围,故不适用。  
10.3 本期国债期货投资评价  
国债期货不属于本基金的的投资范围,故不适用。  
11. 投资组合报告附注  
11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。  
11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。  
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,627.21
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	137,530,570.39
6	其他流动资产	-
7	合计	-
8	合计	137,568,197.60

11.4 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。  
11.5 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。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
本报告因中国证券业协会网站,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和合计可能在尾数上略有差异。  
第七部分 投资组合业绩  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本招募说明书所载自2015年9月25日至2018年12月31日止的基金业绩比较基准为: 报告期末基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	①-④
2015.9.25-2015.12.31	2.30%	0.08%	1.99%	0.08%	0.31%	-0.00%
2016.1.1-2016.12.31	3.86%	0.07%	-1.63%	0.09%	5.49%	-0.02%
2017.1.1-2017.12.31	2.78%	0.04%	-3.38%	0.06%	6.16%	-0.02%
2018.1.1-2018.12.31	7.95%	0.05%	4.79%	0.07%	3.16%	-0.02%
2015.9.25-2018.12.31	1					