

(上接 C41 版)

网站:www.gbc.com.cn
27) 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
办公地址:深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人:何之江
联系人:周一周
联系电话:021-38673436
客服电话:400-8816-168
传真:0755-82400862
网站:istock.pingan.com
28) 国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路 13 号
办公地址:广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人:何春梅
联系人:牛孟平
联系电话:0755-83709350
客服电话:05563
网站:www.guohai.com.cn
29) 东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层
办公地址:上海市浦东新区东陆路 1928 号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
网站:201-20333333
传真:021-50988225
联系人:王蓉
客服电话:05531;400-8888-588
网站:www.longone.com.cn
30) 恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座
办公地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座
法定代表人:庞介民
联系人:陈雨
电话:0471-3935168
传真:0471-3929545
客服电话:400-196-6188
网站:www.cnht.com.cn
31) 申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
法定代表人:韩志谦
联系人:王怀春
联系电话:0991-2307105
传真:010-88085195
客服电话:4008000562
网站:www.hysec.com
32) 中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 2018 号
办公地址:山东省济南市经七路 86 号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:许曼华
联系电话:021-20315117
客服电话:95538
传真:0531-6889752
网站:www.zts.com.cn
33) 第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼
办公地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
电话:0755-23838701
客服电话:95538
网站:www.firstcapital.com.cn
34) 德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址:上海市福州路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人:姚晓春
联系人:刘璐
电话:021-68761616
网站:www.tebon.com.cn
35) 华鑫证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
法定代表人:李斌
联系人:陈琳
电话:021-38784818-8502
传真:021-68774818
客服电话:400-820-5999
网站:www.shhxzq.com
36) 华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元
法定代表人:俞洋
办公地址:上海市徐汇区宛平南路 8 号
联系人:杨莉娟
业务联系电话:021-54967552
传真电话:021-54967293
网站:www.cicc.com.cn
客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
37) 联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:深圳市福田区深南中路 2002 号中广大厦北楼 10 楼
法定代表人:徐刚
联系人:彭澎
电话:0755-83331195
客服电话:95564
网站:www.lxqz.com.cn
38) 国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街 95 号
办公地址:四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧璐、贾鹏
电话:028-86690057;028-86690058
客服电话:95310
公司网址:www.gjzq.com.cn
39) 天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
法定代表人:余磊
联系人:岑婕
电话:027-87617017
客服电话:95391;400-800-5000
网站:http://www.tfzq.com/????????????????
40) 开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层
办公地址:西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层
法定代表人:李刚
联系人:袁伟涛
电话:029-63387289
传真:029-81887060
客服电话:400-860-8866
网站:www.kysec.com.cn
41) 厦门证券承销有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室
办公地址:厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室
邮政编码:361002
法定代表人:陈洪生
联系人:陈承智
电话:0592-3122673
传真:0592-3122704
客服电话:400-918-0808
42) 天津国美基金销售有限公司
注册地址:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二楼 202-124 室
办公地址:北京市朝阳区云霞路 26 号润大厦 B 座 9 层
法定代表人:丁东华
联系人:郭莹莹
电话:010-59297984
传真:010-59287825
客服电话:400-111-0889
43) 上海煜基基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网站:www.juyfund.com.cn
44) 奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 1101 室(深圳证券交易所证券服务分公司)
办公地址:深圳市福田区海天三路海岸城大厦 1115、1116 及 1307 室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
电话:0755-8946 0500
传真:0755-2167 4453
客服电话:400-654-0500
网站:www.ifastps.com.cn
45) 上海云湾投资管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
法定代表人:戴新荣
联系人:江辉
电话:021-20530224
传真:021-20538999
客服电话:400-820-1515
网站:www.zhengtongfund.com
46) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 15 楼
法定代表人:王之光
联系人:宁博宇

电话:021-20649592
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
47) 海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
联系人:毛林
电话:021-80133597
传真:021-80133513
客服电话:400-808-1016
公司网址:www.fundhai.com
48) 华瑞保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层
办公地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层
法定代表人:吴昊
联系人:郭明
电话:021-61058785
传真:021-61058515
客服电话:400-111-5818
网站:www.huairuifund.com
49) 中衍期货有限公司
注册地址:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人:张皓
联系人:韩钰
电话:010-6083 3754
传真:010-5776 2999
客服电话:400-990-8826
网站:www.cincof.com
50) 世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层
邮政编码:518000
法定代表人:姜昧军
联系人:王雯
客服电话:4008-323-000
网站:www.csc.com.cn
51) 华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
邮政编码:230081
法定代表人:李工
联系人:范程
客服电话:95318
网站:www.haazq.com
52) 上海煜基基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室
法定代表人:王翔
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
网站:www.juyfund.com.cn
53) 中民财富管理(上海)有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层
办公地址:上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层 05 单元
法定代表人:胡斌
联系人:黄鹏
电话:021-33355333
传真:021-63353736
客服电话:400-876-5716
网站:www.cnmiwm.com
54) 上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址:上海市浦东新区张杨路 707 号生利人寿大厦 32 楼
联系人:杨涛
电话:021-50260603
传真:021-50260601
客服电话:021-50260003
公司网站 http://www.wendefund.com
2. 基金管理人可根据有关法律法规要求, 根据实情, 选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构, 并及时公告。
二、基金登记机构
平安基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
法定代表人:罗春凤
电话:0755-22624581
传真:0755-29900888
联系人:张平
二、律师事务所和经办律师
律师事务所:上海市通力律师事务所
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
电话:021-3135 8666
传真:021-3135 8600
经办律师:黎明、陈颀华
联系人:陈颀华
四、会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
法定代表人:李丹
联系电话:(021)2323 8888
传真电话:(021)2323 8800
经办注册会计师:曹翠丽、陈怡
联系人:陈怡

风险及资产配置的管理, 以使投资组合的各种风险在控制范围之内。
(2) 类属资产配置策略
根据不同债券资产品种收益与风险的估计和判断, 通过分析各类资产的对收益和风险因素, 确定不同债券种类的资产配置比例。主要决策依据包括未来的宏观经济和利率环境研究和预测, 利率变动情况、市场容量、信用等级情况和流动性情况等。通过情景分析的方法, 判断各个债券类别的预期持有期回报, 在不同债券品种之间进行配置。
在类属资产配置层面上, 本基金根据市场和类属资产的信用水平, 在同类各子类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有合理利率水平基础上, 将市场细分及交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等市场, 结合各类资产的市场容量、信用等级和流动性特点, 在目标久期管理的基础上, 运用均值-方差等模型, 定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整, 确定类属资产的最优配置。
同时, 本基金针对债券市场所处及行业在同样宏观周期背景下不同行业的景气度情况, 通过分散化投资和行业预判进行, 具体表现为: 1) 分散化投资: 发行人涉及众多行业, 本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构, 避免过度集中配置在产业链高度相关的上下游行业; 2) 行业投资: 本组合将依据对下一阶段行业景气度特征的研判, 确定下一阶段在各行业的配置比例, 卖出景气度降低行业的债券, 提前布局景气度提升行业的债券。
(3) 息差策略
本基金将通过正回购, 融资买入收益率高于回购成本的债券, 适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报, 选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种, 灵活控制杠杆持仓仓位, 降低组合波动率。
(4) 券选择策略
在个券选择过程中, 本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的投资价值, 综合判断个券的投资价值, 选择风险收益特征最匹配的品种, 构建具体的投资组合。
1) 信用债投资策略
在信用债的选择方面, 本基金将通过对行业经济周期, 发行主体内外评级和市场利差分析等判断, 并结合收益差异和信用风险溢价综合判断个券的投资价值, 加强对企业债、公司债等个券的投资, 通过对信用债的分析和管理, 获取超额收益。
本基金还将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同, 密切关注两市场之间的交易波动情况, 积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。
2) 中小企业私募债券投资策略
针对中小企业私募债券, 本基金以持有到期, 获得本金和票息收入为主要投资策略, 同时, 密切关注债券的信用风险变化, 力争在控制风险的前提下, 获得较高收益。本基金投资中小企业私募债券, 基金管理人将根据审慎原则, 制定严格的投资决策流程, 风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案, 并经董事会批准, 以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
3) 可转债投资策略
可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性, 具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金主要从公司基本面分析、理论定价分析、债券发行条款、投资导向的变化等方面综合评价可转债投资价值, 选取具有较高价值的可转债进行投资。本基金将着重对可转债对应的基础股票进行研究与分析, 对那些有着良好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择。
本基金还将密切关注可转换债券在二级市场可能存在的价差所带来的投资机会, 在严格控制风险的前提下, 参与可转换债券的一级市场申购, 获得稳定收益。
3) 杠杆投资策略
本基金将综合考虑债券投资的风险收益以及回购成本等因素, 在严格控制投资风险的前提下, 通过正回购, 获得杠杆放大收益。开放期内, 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%; 封闭期内, 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%。
4) 国债期货投资策略
本基金在进行国债期货投资时, 将根据风险管理原则, 以套期保值为主要目的, 采用流动性好、交易活跃的期货合约, 通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究, 结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平, 与现货资产进行匹配, 通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的投资收益性、流动性及风险性特征, 运用国债期货对冲系统性风险, 对冲特殊情况下的流动性风险, 如大额申购赎回等; 利用金融衍生产品的杠杆作用以达成降低投资组合的整体风险的目的。
5) 资产支持证券投资策略
深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素, 估计资产违约风险和提前偿付风险, 并根据资产证券化的收益结构安排, 模拟资产支持证券的本金偿还和利息支付的现金流过程, 辅助采用蒙特卡罗方法等数量化定价模型, 评估内在价值和结合资产支持证券类资产的市场特点, 进行此类品种的资产。
(二) 开放期投资策略:
开放期内, 本基金为保持较高的组合流动性, 方便投资人安排投资, 在遵守 本基金有关投资限制与投资比例的前提下, 将主要投资于高流动性的投资品种, 防范流动性风险, 满足开放期流动性的需求
四、投资限制
1. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1) 本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%;
(2) 开放期内每个交易日日终扣除国债期货需缴纳的交易保证金后, 保持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, 在封闭期内, 本基金不受上述 5% 的限制, 但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(3) 本基金持有一家上市公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%; 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;
(4) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
(5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;
(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;
(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降, 不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
(11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%, 债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;
(12) 本基金投资流通受限证券, 基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
(3) 本基金若参与国债期货交易, 需遵守下列投资比例限制:
1. 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;
2. 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;
3. 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;
4. 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;
(4) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的 10%; 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限, 不得超过当期的剩余封闭期;
(5) 开放期内, 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%; 封闭期内, 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%;
(6) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
(7) 在开放期内, 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金被动投资于流动性受限资产的市值合计超过上述比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(8) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资或者活动。
除上述(二)、(10)、(17)、(18)项以外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述规定比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 则本基金投资可不再受相关限制或按变更后的规定执行。
2. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或活动:
(1) 承销证券;
(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
(3) 从事承担无限责任的投资;
(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券

交易活动;
(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事应至少每半年对关联交易事项进行审查。
如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定, 不适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。
五、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 中证全债指数收益率
中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券构成, 中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标, 为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价性指标。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场, 具有广泛的市场代表性, 适合作为本基金的业绩比较基准。
若未来法律法规发生变化, 或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布, 本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则, 在与基金托管人协商一致并履行适当程序后, 适当调整业绩比较基准并及时公告, 而无须召开基金份额持有人大会。
六、风险收益特征
本基金为债券型基金, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 低于混合型基金、股票型基金。
七、基金投资组合报告
基金管理人及董事会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。
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定, 复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日, 本财务报表数据未经审计。
1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中: 股票	-	-	-
2	固定收益投资	1,479,112,811.12	97.40
其中: 债券	1,290,801,172.20	85.00	
资产支持证券	188,311,638.92	12.40	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,000.00	0.13
其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,942,474.56	1.12
8	其他资产	20,570,426.75	1.35
9	合计	1,518,625,732.43	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股通股票。
1.3 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
本基金本报告期末未持有股票。
1.4 报告期末按投资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	29,383,766.20	2.54
其中: 政策性金融债	29,383,766.20	2.54	
4	企业债券	226,212,306.00	19.55
5	企业短期融资券	660,883,100.00	57.11
6	中期票据	161,457,000.00	13.95
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	212,865,000.00	18.39
9	其他	-	-
10	合计	1,290,801,172.20	111.54

1.5 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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011801832	18 吉林高速 SCMP05	700,000	70,035,000.00	6.05
2	011801834	18 首航 SCMP09	500,000	50,005,000.00	4.32
3	011801864	18 云锦债 SCMP03	500,000	49,970,000.00	4.32
4	111810419	18 兴业银行 CD149	500,000	48,705,000.00	4.21
5	111815197	18 民生银行 CD197	500,000	48,150,000.00	4.16

1.6 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	146560	花呗 40A1	500,000	50,583,828.77	4.37
2	146650	借呗 42A1	400,000	40,483,835.62	3.50
3	146569	借呗 38A1	250,000	25,292,715.76	2.19
4	146735	17 花呗 05A1	200,000	20,286,884.93	1.75
5	146689	花呗 50A1	200,000	20,285,260.27	1.75
6	146712	借呗 45A1	200,000	20,251,841.10	1.75
7	146563	借呗 36A1	70,000	7,078,297.40	0.61
8	146557	借呗 35A1	40,000	4,048,995.07	0.35

1.7 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投资。
1.8 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。
1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.9.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未进行国债期货投资。
1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货持仓。
1.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未进行国债期货投资。
1.10 投资组合报告附注
1.10.1
本组合投资的前十名证券之一兴业银行于 2018 年 4 月 19 日被监管公开处罚, 主要违法违规事实包括:(一) 重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二) 非真实转让信贷资产;(三) 无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四) 内控管理严重违法违反审慎经营规则, 多家分支机构购买返售业务四项基础资产违规;(五) 同业投资接受受限性, 第三方金融机构信用担保;(六) 债券类资产业务违规出资;(七) 个人理财资金违规投资;(八) 提供日期调整的材料;(九) 部分非现场监管统计数据与事实不符;(十) 个别董事未在任职期间履职;(十一) 变相批量转让个人贷款;(十二) 向四证不全的房地产项目提供融资。中国银保监会监管部门决定罚款兴业银行 5870 万元。
本基金管理人对该公司进行了深入了解和分析, 认为该事项对公司的盈利情况不会产生重大不利影响。因此, 我们对该证券的投资决策执行内部投资决策流程, 符合法律法规和公司制度的规定。
1.10.2
本基金本报告期末持有股票。
1.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,765.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,562,447.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,213.97
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,570,426.75

1.10.4 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。
1.10.5 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。
1.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因, 分项之和与合计可能有尾差。
八、基金的费用
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, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者有做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。
一、自基金合同生效以来(2016 年 11 月 2 日)至 2018 年 9 月 30 日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准收益差③	业绩比较基准收益差率④	①-③	②-④
2016.11.2-2016.12.31	0.01%	0.13%	-2.26%	0.16%	2.27%	-0.03%
2017.1.1-2017.6.30	2.14%	0.66%	-0.20%	0.07%	2.34%	-0.01%
2017.7.1-2017.12.31	0.58%	0.05%	-0.14%	0.05%	0.02%	0.00%
2018.1.1-2018.6.30	2.92%	0.08%	4.35%	0.08%	-1.43%	0.00%
2018.7.1-2018.9.30	2.78%	0.08%	1.35%	0.07%	1.43%	0.01%
自合网成立以来	7.48%	0.07%	3.02%	0.08%	4.46%	-0.01%

基金业绩比较基准: 中证全债指数收益率
二、自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

注: 1、本基金基金合同于 2016 年 11 月 2 日正式生效, 截至报告期末已满两年;
2、按照本基金的基金合同规定, 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定, 截至报告期末本基金已完成建仓。建仓结束后, 各项资产配置比例符合基金合同的约定。
九、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. 基金的证券、期货交易费用;
7. 基金的银行汇划费用;
8. 基金的账户开户费用和账户维护费;
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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下:
H= E×0.60%÷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
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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 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 0.08% 年费率计提。托管费的计算方法如下:
H= E×0.08%÷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
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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。
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、税收政策
本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
第十部分 其他应披露事项
(一) 本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。
(二) 最近半年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。
(三) 2018 年 5 月 2 日至 2018 年 11 月 1 日发布的公告:
1. 2018 年 6 月 1 日, 关于平安大华基金定期开放债券型证券投资基金基金