

# 投资组合报告

## 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	795,507,812.80	98.04
	其中：债券	795,507,812.80	98.04
	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	-	-
	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	1,274,444.64	0.16
8	其他资产	14,651,727.93	1.81
9	合计	811,433,985.37	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

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	-	-
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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-

注：注：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

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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

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（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 1.4 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	10,687,137.00	1.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,141,000.00	21.05
	其中：政策性金融债	140,141,000.00	21.05
4	企业债券	29,298,275.80	4.40
5	企业短期融资券	210,585,000.00	31.63
6	中期票据	307,706,400.00	46.22
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	97,090,000.00	14.58
9	其他	-	-
10	合计	795,507,812.80	119.50

### 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	111915064	19 民生银行 CD064	1,000,000	97,090,000.00	14.58
2	101764039	17 晋能 MTN004	500,000	51,400,000.00	7.72
3	011900306	19 平安不动 SCP002	500,000	50,200,000.00	7.54
4	101800443	18 津城建	430,000	43,485,900.00	6.53

		MTN010A			
5	101800773	18 首钢 MTN002	400,000	41,080,000.00	6.17

### 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（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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股指期货交易情况说明

#### 1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

#### 1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 1.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
国债期货投资本期收益 (元)					-
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 1.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 1.11 投资组合报告附注

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

无。

1.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

按照本基金基金合同规定，本基金不投资于股票。

## 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	8,468.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,639,271.03
5	应收申购款	2,003,988.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,651,727.93

## 1.11.4 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净	流通受限情
----	------	------	-------------	--------	-------

			(元)	值比例 (%)	况说明
-	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期末未持有股票。

#### 1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。