

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801019	08央行票据19	1,900,000	183,369,000.00	11.05
2	0801028	08央行票据28	1,000,000	96,660,000.00	5.82
3	010210	02国债01	800,000	80,640,000.00	4.86
4	040022	04国债02	500,000	53,085,000.00	3.20
5	-	-	-	-	-

7) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

9) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

1) 基金管理人没有发现本基金投资组合前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序特别提示说明。

2) 本基金为债券基金,没有特定股票备选库,所投资的前十名股票均按基金合同规定在一级市场申购所得股票。

3) 其他资产构成

序号	资产构成名称	金额(元)
1	应收利息	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	87,721,213.37
5	应收利息	224,703,020.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	312,674,234.13

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。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

3) 投资组合构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	10,312,625.00	0.24
	其中:股票	10,312,625.00	0.24
2	固定收益投资	3,691,152,193.60	84.73
	其中:债券	3,691,152,193.60	84.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	342,450,938.12	7.86
6	其他资产	312,674,234.13	7.18
7	合计	4,356,589,890.83	100.00

3) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	272,625.00	0.01
C1	食品、饮料	-	-
C2	纺织、服装、皮毛	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C6	电子	272,625.00	0.01
C61	金属、非金属	-	-
C7	医药、设备、仪器	-	-
C8	生物、制药	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,040,000.00	0.23
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	10,312,625.00	0.24

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	601186	中国铁建	1,000,000	10,040,000.00	0.23
2	000257	立立电子	12,500	272,625.00	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

6) 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	56,701,633.60	1.30
2	央行票据	3,107,605,000.00	71.47
3	中期票据	384,605,000.00	8.85
4	企业债	384,605,000.00	8.85
5	可转债	142,240,560.00	3.27
6	可分离债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,691,152,193.60	84.89

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801047	08央行票据47	11,000,000	1,175,900,000.00	27.04
2	0801065	08央行票据65	10,000,000	1,072,200,000.00	24.66
3	0801044	08央行票据44	3,300,000	352,605,000.00	8.11
4	0801092	08央行票据92	2,000,000	203,520,000.00	6.75
5	0801035	08央行票据35	2,000,000	213,380,000.00	4.91

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
 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名的前十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

1) 基金管理人没有发现本基金投资组合前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序特别提示说明。

2) 本基金为债券基金,没有特定股票备选库,所投资的前十名股票均按基金合同规定在一级市场申购所得股票。

3) 其他资产构成

序号	资产构成名称	金额(元)
1	应收利息	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	87,721,213.37
5	应收利息	224,703,020.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	312,674,234.13

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。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

3) 投资组合构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	10,312,625.00	0.24
	其中:股票	10,312,625.00	0.24
2	固定收益投资	3,691,152,193.60	84.73
	其中:债券	3,691,152,193.60	84.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	342,450,938.12	7.86
6	其他资产	312,674,234.13	7.18
7	合计	4,356,589,890.83	100.00

3) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	272,625.00	0.01
C1	食品、饮料	-	-
C2	纺织、服装、皮毛	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C6	电子	272,625.00	0.01
C61	金属、非金属	-	-
C7	医药、设备、仪器	-	-
C8	生物、制药	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,040,000.00	0.23
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	10,312,625.00	0.24

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	601186	中国铁建	1,000,000	10,040,000.00	0.23
2	000257	立立电子	12,500	272,625.00	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

6) 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	56,701,633.60	1.30
2	央行票据	3,107,605,000.00	71.47
3	中期票据	384,605,000.00	8.85
4	企业债	384,605,000.00	8.85
5	可转债	142,240,560.00	3.27
6	可分离债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,691,152,193.60	84.89

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801047	08央行票据47	11,000,000	1,175,900,000.00	27.04
2	0801065	08央行票据65	10,000,000	1,072,200,000.00	24.66
3	0801044	08央行票据44	3,300,000	352,605,000.00	8.11
4	0801092	08央行票据92	2,000,000	203,520,000.00	6.75
5	0801035	08央行票据35	2,000,000	213,380,000.00	4.91

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
 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名的前十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

8) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

1) 基金管理人没有发现本基金投资组合前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序特别提示说明。

2) 本基金为债券基金,没有特定股票备选库,所投资的前十名股票均按基金合同规定在一级市场申购所得股票。

3) 其他资产构成

序号	资产构成名称	金额(元)
1	应收利息	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	87,721,213.37
5	应收利息	224,703,020.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	312,674,234.13

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。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

3) 投资组合构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	10,312,625.00	0.24
	其中:股票	10,312,625.00	0.24
2	固定收益投资	3,691,152,193.60	84.73
	其中:债券	3,691,152,193.60	84.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	342,450,938.12	7.86
6	其他资产	312,674,234.13	7.18
7	合计	4,356,589,890.83	100.00

3) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	272,625.00	0.01
C1	食品、饮料	-	-
C2	纺织、服装、皮毛	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C6	电子	272,625.00	0.01
C61	金属、非金属	-	-
C7	医药、设备、仪器	-	-
C8	生物、制药	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,040,000.00	0.23
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	10,312,625.00	0.24

6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	601186	中国铁建	1,000,000	10,040,000.00	0.23
2	000257	立立电子	12,500	272,625.00	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

6) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	
----	--