

鹏华丰收债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2014年7月19日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者自行承担投资风险，投资者应仔细阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的风险承受能力选择基金产品。
本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

5.2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金名称 | 鹏华丰收债券型证券投资基金 |
| 基金代码 | 160615 |
| 交易场所 | 深圳证券交易所 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年5月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,468,827,194.15份 |
| 投资目标 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，通过主动投资管理追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。通过宏观经济、政策、利率、信用、流动性等因素的综合分析，自上而下地确定投资组合的大类资产配置比例，并在此基础上，自下而上地选择具有良好流动性的固定收益类品种，构建投资组合，追求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期的风险收益低于股票型基金、混合型基金、货币型基金，为证券投资基金中的低风险品种。 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

5.3 主要财务指标和基金净值表现

| | |
|--|---------------------------|
| 单位：人民币元 | |
| 本报告期 | 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日) |
| 1.本期已实现收益 | 12,627,347.31 |
| 2.本期利润 | 52,578,403.16 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0360 |
| 4.本期基金净值增长 | 1,504,497,899.94 |
| 5.本期基金份额净值 | 1.024 |
| 注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益； | |
| 2.所述基金净值指标不包括有认购、赎回、申购、赎回、转换、基金转换费等，计入费用后实际收益水平高于所列示。 | |

| | | | | | |
|-------|-------|----------|-----------|-------|--------|
| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | ①-③ | ②-④ |
| 过去三个月 | 3.54% | 0.09% | 3.51% | 0.11% | -0.02% |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 1 | 601398 | 工商银行 | 5,900,000 | 20,081,000.00 | 1.33 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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 | 100003 | 国债03 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 1 | 069939 | 浦发转债 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | |
|--|----------|----------------|--------------|
| 5.3 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资产支持证券投资明细 | | | |
| 序号 | 资产名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 鹏华资产支持证券 | 104,437,000.00 | 6.94 |

| | | | |
|---------------------------------------|-------|--------------|--------------|
| 5.3 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贵金属投资明细 | | | |
| 序号 | 贵金属名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 国际黄金 | 6,000,463.00 | 0.40 |

| | | | |
|--|-----------|----------------|--------------|
| 5.3 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指期货投资明细 | | | |
| 序号 | 股指期货名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 沪深300股指期货 | 104,437,000.00 | 6.94 |

| | | | |
|--|--------|----------------|--------------|
| 5.3 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国债期货投资明细 | | | |
| 序号 | 国债期货名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 国债期货 | 127,156,481.40 | 8.62 |

| | | | |
|--|----------|----------------|--------------|
| 5.3 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货币市场基金投资明细 | | | |
| 序号 | 货币市场基金名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 鹏华货币 | 303,333,000.00 | 20.6 |

| | | | |
|--|--------|---------------|--------------|
| 5.3 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其他资产投资明细 | | | |
| 序号 | 其他资产名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 中国国债 | 29,442,000.00 | 1.98 |

| | | | |
|--|--------|---------------|--------------|
| 5.3 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其他资产投资明细 | | | |
| 序号 | 其他资产名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 可转债 | 46,382,437.40 | 3.06 |

| | | | |
|--|--------|------------------|--------------|
| 5.3 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其他资产投资明细 | | | |
| 序号 | 其他资产名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 1 | 其他 | 1,833,156,763.80 | 95.26 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 1 | 128251 | 12国债01 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 2 | 128265 | 12国债02 | 600,000 | 6,000,000.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 3 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 4 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 5 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 6 | 128252 | 12国债10 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 7 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 8 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 9 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 10 | 128251 | 12国债01 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 11 | 128265 | 12国债02 | 600,000 | 6,000,000.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 12 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 13 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 14 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 15 | 128252 | 12国债10 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 16 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 17 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 18 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 19 | 128251 | 12国债01 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 20 | 128265 | 12国债02 | 600,000 | 6,000,000.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 21 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 22 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 23 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 24 | 128252 | 12国债10 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 25 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 26 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 27 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 28 | 128251 | 12国债01 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 29 | 128265 | 12国债02 | 600,000 | 6,000,000.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 30 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 31 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 32 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 33 | 128252 | 12国债10 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 34 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 35 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 36 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 37 | 128251 | 12国债01 | 1,000,000 | 10,000,000.00 | 0.67 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 38 | 128265 | 12国债02 | 600,000 | 6,000,000.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 39 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 40 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 41 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 42 | 128252 | 12国债10 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 43 | 128249 | 12国债03 | 600,000 | 6,104,000.00 | 0.406 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 44 | 122711 | 12国债08 | 500,000 | 5,000,000.00 | 0.352 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 5.3 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(%) |
| 45 | 122872 | 12国债09 | 500,000 | 5,104,000.00 | 0.344 |