

## （上接B53版）

本基金投资于中期票据,本基金将按照基金合同约定投资于上市开放式基金(LOF)、货币(LOF)、股票(LOF)的基金(指符合各自基金合同约定的基金品种并转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金申购、赎回业务。基金合同生效后3个月内,到期赎回的基金转换为本招募说明书第二部分及基金管理人颁布发布的相关公告。

## 七、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

## 八、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可分离交易可转债中的中小企业私募债、中期票据、中期融资券、地方政府债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具以及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)。

本基金不能投资于一级市场人股票、权证、可转债等,也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的60%,其中投资于中小企业私募债券的比例不高干基金资产的20%,现或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

## 九、基金的投资策略

1.固定收益品种的配置策略

(1)久期策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(2)期限结构策略

在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用统计和数量分析方法,对各期限的风险收益情况进行比较,对收益曲线不同期限的骑乘收益进行分析,在子组合、红利组合和梯形组合中选择风险收益比较优的配置方案。

(3)债券类别配置策略

子组合之间,使组合的现金流尽量集中分布;在组合内部,使组合的现金流尽量呈现金梯分布;梯级组合,使组合的现金流在组合内尽可能平均分布。

(4)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(5)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(6)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(7)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(8)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(9)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(10)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(11)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(12)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(13)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(14)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(15)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(16)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(17)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(18)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(19)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(20)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(21)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(22)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(23)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(24)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(25)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(26)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(27)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(28)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(29)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(30)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(31)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(32)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(33)债券类别配置策略

本基金将对宏观经济政策(包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等)和宏观经济环境(包括货币政策、财政政策和产业政策等)的分析,判断宏观经济所处的经济周期,由此判断利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期中的特性,即债市市场周期、债市资产市场周期,确定债券资产配置的基本方向和特征,同时结合债券市场资金供求分析,最终确定投资组合久期及债券资产配置策略。

(3)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%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券10%;

(5)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的10%;

(6)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%;

(7)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%;

(8)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%;

(9)本基金投资于信用评级为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;

(10)本基金在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%;

(11)本基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不得超过该证券的10%;

(12)本基金持有的全部中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;本基金持有的中小企业私募债券的剩余期限不得超过该债券剩余额的20%;

(13)本基金管理人不得违反法律法规、监管部门及基金合同约定的其他限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。基金管理人应在基金合同约定的范围内,根据法律法规、监管部门及基金合同约定的其他限制,调整投资组合,但不得违反法律法规及基金合同的有关规定。

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活动:

(1)承销证券;

(2)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,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大关联关系的关联发行证券等承销期未满的证券;

(7)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;

(8)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

十一、基金的投资业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中证全债指数

如果今后法律法规发生变化,或在法律法规、证监会及市场普遍接受的业内权威机构提出,或者是市场上出现更适用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案后变更本基金的业绩比较基准并及时公告,而无须基金份额持有人大会审议。

十二、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金。

本基金(基金合同)生效之日起3年内,本基金按照固定收益类资产占比,划分为低风险、收益相对稳定的基金类别;3年后,本基金按照固定收益类资产占比,划分为中低风险、收益稳定的基金类别。

十三、基金的投资报告

基金管理人的董事及董事保证本基金投资运作相关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。

基金托管人招商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。

本报告投资组合数据截至2016年2月19日,本报告中列示的数据未经审计。

1. 基金资产净值情况

截至2016年2月19日,中海基金纯债分级债券型发起式证券投资基金资产净值为698,280,348.26元,基金份额净值为1.243元,累计基金份额净值为1.282元,其投资组合情况如下:

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	698,244,379.20	99.31
3	本基金	698,244,379.20	99.31
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产支持证券投资	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	13,965,969.06	1.97
9	其他	1,003,000.00	0.14
10	合计	708,913,348.24	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

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

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

4.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

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

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权证投资明细

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

6.报告期末本基金投资的股指期货投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

7.报告期末本基金投资的国债期货投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

8.报告期末本基金投资的资产支持证券投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

9.报告期末本基金持有的贵金属(金条、黄金ETF合约)投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

10.报告期末本基金持有的其他金融资产投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

11.报告期末本基金持有的所有金融资产及其公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

12.报告期末本基金持有的所有负债及其公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

13.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

14.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

15.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

16.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

17.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

18.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

19.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

20.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

21.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

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

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

4.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

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

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权证投资明细

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

6.报告期末本基金投资的股指期货投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

7.报告期末本基金投资的国债期货投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

8.报告期末本基金投资的资产支持证券投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

9.报告期末本基金持有的贵金属(金条、黄金ETF合约)投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

10.报告期末本基金持有的其他金融资产投资

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

11.报告期末本基金持有的所有金融资产及其公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

12.报告期末本基金持有的所有负债及其公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

13.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

14.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

本基金为纯债基金,不进行股票投资。

15.报告期末本基金持有的所有资产和负债的公允价值

</