

(上接B202版)

传真:(021)23238800
联系人:陈霖
经办注册会计师:单峰、陈霖

四、基金的名称

鹏华纯债债券型证券投资基金(基金简称:鹏华纯债债券;基金代码:206015)

五、基金运作方式和类型

契约开放式,债券型基金

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,通过严格的利率分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款以及法律法规和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)。本基金不直接买入股票,对公允价值计量资产的投资比例不超过基金资产净值的5%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资理念
超额收益来源于对宏观因素和利率曲线变动的分析和把握。
(二)投资策略
本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅以信用利差策略。收益曲线策略、短期融资券、息差策略、可转债策略等积极投资策略,在严格控制风险的基础上,通过严格的利率分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
1.资产配置策略
在资产配置方面,本基金通过对宏观经济走势、经济周期所处阶段、利率曲线变动趋势和利率预期等因素的综合分析,比较未来一定期间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用等级、品种及债券与现金之间进行动态调整。
2.久期策略
本基金将主要采取久期策略,通过自上而下的组合久期管理策略,以实现组合利率风险的有效控制。为控制风险,本基金采用以“目标久期”为主的资产配置方式。目标久期的设定分为两个层次:战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战术性配置由投资决策委员会决定,主要根据对宏观经济前景和利率预期的综合判断。“目标久期”的战略性配置由基金经理根据市场短期因素对宏观经济预期首先确定的范围内进行微调。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,直至接近目标久期上限,以期在较多获得债券资产上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,直至目标久期下限,以减小债券价格下降带来的风险。
3.收益增强策略
收益增强策略的实现方式是判断市场整体走向的依仗之一,本基金将根据市场整体走向,中期债券和短期债券,本基金将根据收益曲线变动趋势的预测,适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合,并进行动态调整。
4.骑乘策略
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析,在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线陡峭处右侧的债券,在收益率曲线不变动的情况下,随着其剩余期限的变短,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大程度的下降,从而获得较高的资本收益,即使收益率曲线上升亦不会受到太大影响,这一策略将能够提供更多的安全边际。

九、基金的风险控制

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得

的债券投资于债券,利用正回购放大债券投资的收益。

6.债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择投资品种,兼顾品种因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

7.投资决策程序

- 1.投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
- (2)国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策;
- (3)固定收益市场发展及各类固收品种情况;
- (4)各行业发展状况、市场流动性和风险特征;
- (5)上市公司研究,包括上市公司成长性的研究和市场走势;
- (6)证券市场走势。

(1)投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;
(2)国内国际宏观经济环境、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、国家产业政策;
(3)固定收益市场发展及各类固收品种情况;
(4)各行业发展状况、市场流动性和风险特征;
(5)上市公司研究,包括上市公司成长性的研究和市场走势;
(6)证券市场走势。

(2)基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:确定本基金总体资产配置和投资策略,投资决策委员会定期召开会议,如需做出及时重大决策或调整小组提议,可随时召开投资决策委员会会议。
(3)基金经理(或管理小组):设计和调整投资组合,设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括:每日基金申购和赎回净现金流量、基金合同的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;基金经理的独立判断;绩效与风险评估小组的建议等。

(4)绩效与风险评估小组:对基金投资组合进行评估,向基金经理(或管理小组)提出调整建议。
(5)监察稽核部:对投资决策流程进行合法合规审核、监督和检查。

九、基金的业绩比较基准

中债总指数收益率*90%+中国国债登记结算公司编制,并在中国债券网(www.chinabond.com.cn)公开发布,具有权威的权威性和市场影响力;该指数将本基金主要类属、国债和政策性金融债,能够较好地反映债券市场的整体收益率水平,是债券型基金、主要投资于固定收益类金融工具,为此,本基金选取中债总指数作为本基金业绩比较基准。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后可以变更业绩比较基准并及时公告,但无需召集基金份额持有人大会。

本基金属于债券型基金,业绩比较基准与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。
本基金管理人的董事及高级管理人员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。
如本报告中出现虚假记载或误导性陈述,本基金管理人将根据中国证监会、2016年7月18日发布了本基金的财务报告、净值表现和投资组合报告等内容,保证该报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告中列财务数据截至2016年6月30日(未经审计)。

1.报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	52,983,162.20	95.25
3	银行存款	52,983,162.20	95.25
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他各项金融资产及其投资	-	-
8	银行存款和拆借金融资产合计	17,977,479.51	3.26
9	其他各项资产	8,170,000.99	1.48
10	合计	50,139,662.62	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	46,907,317.40	95.18
3	银行存款	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他各项金融资产及其投资	-	-
8	银行存款和拆借金融资产合计	2,625,314.84	4.92
9	其他各项资产	21,818.81	0.00
10	合计	49,334,565.55	100.00

标的指数成份股(包含中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、新股(首次发行或增发等)及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。
如法律法规或监管机构以后允许,基金管理人可以在履行适当程序后调整上述投资范围,或将新增的允许投资的品种纳入本基金的投资范围。

本基金为被动式指数基金,以目标ETF作为主要投资标的,方便特定客户群体对本基金投资目标ETF,本基金不运用ETF的投资策略。
本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如指数跟踪偏离调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1.投资组合的构建
本基金投资组合的构建过程主要分为三步:确定目标组合、制定建仓策略和逐步调整组合。
本基金通过投资于目标ETF跟踪标的指数,主要投资品种为目标ETF的指数成份股及其备选成份股。基金经理将对目标ETF的流动性、目标ETF的折溢价、以及标的指数的成份股的流动性和交易成本等因素进行分析,制定合理的建仓策略,并在建仓期间采取逐步建仓的方式进行调整,同时,确定后,标的指数成份股和调整,基金管理人将根据跟踪误差等因素导致基金不符合这一投资比例的,基金管理人将在10个工作日内进行调整。

2.目标ETF的投资方式
本基金投资于目标ETF的两种方式如下:
(1)一级市场申购赎回:目标ETF开放申购赎回后,通过其中购赎回代理券商以组合方式申购赎回;目标ETF上市交易后,通过深圳证券交易所会员机构在二级市场买入和卖出;目标ETF上市交易后,通过深圳证券交易所会员机构在二级市场买入和卖出;目标ETF的交易。
在遵守深圳证券交易所相关业务规则的前提下,本基金将综合考虑上述两种方式的价格因素,以及基金流动性、市场交易等其他相关因素,选择适合的买入或卖出方式。当目标ETF申购、赎回或交易模式发生了变更或调整后,本基金也将作相应的变更或调整。

3.目标ETF的调整
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

4.标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

5.债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来
1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

1. 投资策略
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方法。
(1)当收到申购时,基金将根据申购规模及仓位情况,决定投资组合的构建,目标ETF的申购买入等;
(2)当收到赎回时,基金将根据赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出;

2. 标的指数的成份股、备选成份股投资策略
本基金对标的指数成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建投资组合以申购目标ETF,因此对于投资标的指数的成份股、备选成份股的投资,采取跟踪复制策略,即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

3. 债券投资策略
本基金债券投资将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
注:无。
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
注:无。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:无。
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
注:无。

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
注:无。

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资
产投资明细
注:无。
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
注:无。

9.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:无。
10.报告期末持有的资产支持证券投资明细
注:无。

11.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
12.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

13.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
14.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

15.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
16.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

17.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
18.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

19.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
20.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

21.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
22.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

23.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
24.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

25.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
26.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

27.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
28.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

29.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
30.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

31.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
32.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

33.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
34.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

35.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
36.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

37.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
38.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

39.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
40.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

41.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
42.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

43.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
44.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

45.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
46.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

47.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
48.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

49.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
50.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

51.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
52.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

53.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
54.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

55.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
56.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

57.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
58.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

59.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
60.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

61.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
62.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

63.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
64.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

65.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
66.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

67.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
68.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

69.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
70.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

71.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
72.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

73.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
74.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

75.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
76.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

77.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
78.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。

79.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。
80.报告期末持有的公允价值计量且公允价值变动较大的金融资产投资
明细
注:无。