德邦群利债券型证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31日

基金管理人:德邦基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018年1月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月17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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	德邦群利债券	
基金主代码	003420	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月10日	
报告期末基金份额总额	1,005,692.11份	
投资目标	本基金在严格控制风险并保证充分流动性的前提下,通过积极主动的资产管理,为投资者提供稳健持续增长的投资收益。	
投资策略	本基金通过久期策略、期限结构策略、类属配置策略、信用债投资策略、杠杆投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券的投资策略、个券挖掘策略、国债期货投资策略等多方面进行全面分析,调整投资组合配置。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	德邦群利债券A	德邦群利债券C
下属分级基金的交易代码	003420	003421
报告期末下属分级基金的份额总额	1,001,299.70份	4,392.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年10月1日 - 2017年12月31日)	
	德邦群利债券A	德邦群利债券C
1.本期已实现收益	97,006.96	-148.52
2.本期利润	513,745.50	4,914.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0206	0.2619
4.期末基金资产净值	2,106,066.15	9,227.37
5.期末基金份额净值	2.1033	2.1008

注:1.本基金合同生效日为2017年3月10日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。
2、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。
3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦群利债券A

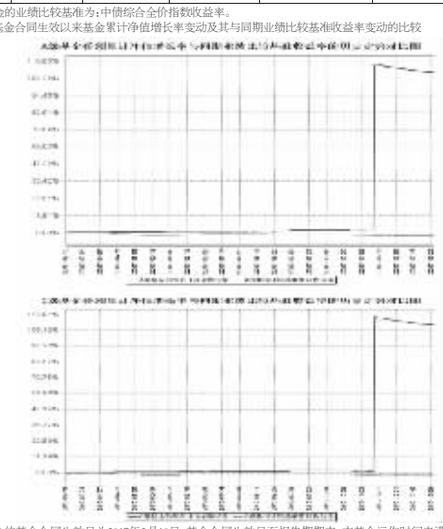
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	105.90%	14.55%	-1.15%	0.06%	107.05%	14.49%

德邦群利债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	106.14%	14.60%	-1.15%	0.06%	107.29%	14.54%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同生效日为2017年3月10日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满1年。本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为2017年3月10日至2017年12月31日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔飞	本基金的基金经理、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦锐银债券型证券投资基金、德邦锐银纯债券型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2017年4月19日	-	6年	学士,2001年2月至2011年2月在平安保险深圳分公司南新营业区担任经理;2011年3月至2015年12月在中投证券上海分公司创新业务部担任总经理助理;2015年12月加入德邦基金管理有限公司,担任产品经理,现任本公司基金经理。

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资组合管理合规性的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

邦群利债券C基金份额净值为2.1008元,本报告期基金份额净值增长率为106.14%;同期业绩比较基准收益率为-1.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2017年11月14日至2017年12月31日期间出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	1,799,798.00	70.40
	其中:债券	1,799,798.00	70.40
	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	705,582.49	27.60
8	其他资产	51,151.68	2.00
9	合计	2,556,532.17	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,799,798.00	85.09
	其中:政策性金融债	1,799,798.00	85.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,799,798.00	85.09

5.5 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	018005	国开1701	18,200	1,799,798.00	85.09

5.6 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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	118.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,033.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,151.68

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	德邦群利债券A	德邦群利债券C
报告期期初基金份额总额	55,079,077.98	106,614.21
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	54,077,778.28	102,221.80
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,001,299.70	4,392.41

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171001 - 20171231	54,999,000.00	0.00	54,000,000.00	999,000.00	99.33%
产品持有人风险							

1.本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大,单一机构投资者的大额赎回,可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响;
2.大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
3.因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,大额赎回导致基金净值出现较大波动;
4.单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回,在发生巨额赎回情形时,在符合基金合同约定情况下,如基金管理人认为有必要,可延期办理本基金的赎回申请,投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险;如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
5.单一机构投资者赎回后,若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的,基金管理人应当向中国证监会提出解决方案,或按基金合同约定,转换运作方式或终止基金合同,其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险;
6.大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;
7.大额赎回导致基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、德邦群利债券型证券投资基金基金合同;
3、德邦群利债券型证券投资基金托管协议;
4、德邦群利债券型证券投资基金招募说明书;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、报告期内按照规定披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件,亦可通过公司网站查询,公司网址为www.dbfund.com.cn。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人。

咨询电话:400-821-7788

德邦基金管理有限公司
2018年1月18日

德邦如意货币市场基金

2017 第四季度 报告

2017年12月31日

基金管理人:德邦基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2018年1月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月17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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	德邦如意货币
基金主代码	001401
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
报告期末基金份额总额	3,496,743,848.05份
投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在保持较高资产流动性的前提下,在对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析的基础上,科学预计未来利率走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	德邦基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年10月1日 - 2017年12月31日)
1.本期已实现收益	41,431,804.75
2.本期利润	41,431,804.75
3.期末基金资产净值	3,496,743,848.05

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;
2、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

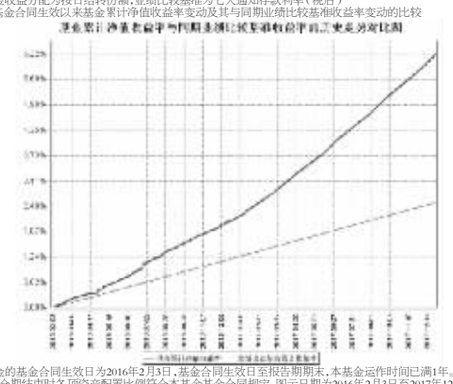
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0402%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.6999%	0.0013%

注:本基金收益分配为按日结转份额,业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同生效日为2016年2月3日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间已满1年。本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为2016年2月3日至2017年12月31日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁玲楠	本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金(LOF)、德邦新动利债券型证券投资基金、德邦现金宝交易型货币市场基金的基金经理。	2017年1月24日	-	6年	硕士,2010年6月至2013年8月担任中国人保资产管理股份有限公司组合管理部投资经理助理;2013年9月至2015年3月担任上海银行资产管理部投资交易员;2016年1月加入德邦基金管理有限公司,任职于投资研发部,现任本公司基金经理。
张铮烁	固定收益部总监助理、本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金(LOF)、德邦德利货币市场基金、德邦增利货币市场基金、德邦稳健6个月定期开放债券型证券投资基金、德邦现金宝交易型货币市场基金的基金经理。	2016年2月3日	-	10年	硕士,2007年7月至2010年7月在中诚信国际信用评级有限责任公司评级部担任分析师,项目经理,2010年8月至2015年5月在安邦资产管理有限责任公司固定收益部担任投资经理,2015年11月加入德邦基金管理有限公司,现任本公司固定收益部总监助理、基金经理。

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资组合管理合规性的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年四季度,受基建投资支撑以及地产投资未出现快速下滑影响,固定资产投资增速继续维持缓慢下行,下行幅度远不及市场预期,而通胀略有上行。资金面方面,虽然央行通过63天逆回购、续做MLF等操作削峰填谷,但四季度资金面仍然整体偏紧,央行在12月14日再度上调MLF和OMO利率5个BP,上调幅度低于市场预期,但受跨年资金稀缺的影响,同业存款、同业存单和跨年逆回购价格持续上行并创年内新高。

四季度,债券收益率持续上行,10月下旬,受美债收益率上行、资金面重回紧张、担忧监管政策、市场一致预期四季度经济会出现下行导致交易盘较为拥挤等因素影响,债券市场经历了快速调整,收益率大幅上行。11-12月市场分歧仍然较大,对经济基本面韧性的担忧、对监管政策的担忧、对跨年资金面紧张的担忧导致收益率继续大幅上行。

目前虽然经济基本面仍有继续下行压力,但预计经济韧性仍然较大,货币政策也将延续中性偏紧的方向,后续预计仍将有更加严格和细致的监管政策出台。同时,债券绝对收益率较高,已经具备配置价值,短端相对于长端安全边际更高。

报告期内,本基金严格遵守货币基金相关法律法规,保持较为稳健的投资风格,按照法律法规所规定的品种、久期、杠杆比例等要求进行投资操作,并严格把控信用风险,优选投资标的。同时,本基金密切跟踪经济基本面、政策面、资金面等情形,做好组合投资安排,在月末、季末、年末等时点,提前预备充足的流动性,做好基金的流动性管理,努力为投资人赚取收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为1.0402%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	2,037,153,317.09	55.33
	其中:债券	2,037,153,317.09	55.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	198,267,977.40	5.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,419,849,151.60	38.56
4	其他资产	26,844,949.86	0.73
5	合计	3,682,115,395.95	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.56
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	177,449,213.82	5.07
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内,本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内,本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	17.83	5.07
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	31.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	5.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	26.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.53	5.07

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内,本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	169,098,480.66	4.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,992,700.07	1.72
	其中:政策性金融债	59,992,700.07	1.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	490,271,706.31	14.02
6	中期票据	30,039,193.46	0.86
7	同业存单	1,287,751,236.59	36.83
8	其他	-	-
9	合计	2,037,153,317.09	58.26
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111718281	17平夏银行CD281	1,000,000	99,625,677.33	2.85
2	179947	17贴现国债47	700,000	69,913,141.22	2.00
3	011764053	17晋阳江SCP002	600,000	60,180,476.77	1.72
4	011751058	17延州煤业SCP003	600,000	60,092,927.11	1.72
5	179960	17贴现国债60	600,000	59,463,676.62	1.70
6	011754098	17银川SCP001	500,000	50,073,416.18	1.43
7	011758068	17深能源SCP002	500,000	50,016,678.67	1.43
8	111796071	17招庆银行CD073	500,000	49,892,408.04	1.43
9	011759119	17鹿高速SCP003	500,000	49,860,120.77	1.43
10	111790881	17鄂商银行CD024	500,000	49,843,722.87	1.43

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.4490%
报告期内偏离度的最低值	-0.0477%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0270%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.9.2

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,818,137.69
4	应收申购款	6,026,812.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,844,949.86

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入的原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,627,015,694.24
报告期期间基金总申购份额	8,584,049,811.36
报告期期间基金总赎回份额	9,714,321,657.55
报告期期末基金份额总额	3,496,743,848.05

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利发放	2017年10月9日	26,065.98	0.00	0.00%
2	红利发放	2017年10月10日	2,613.47	0.00	0.00%
3	红利发放	2017年10月11日	2,601.49	0.00	0.00%
4	申购	2017年10月12日	4,000,000.00	4,000,000.00	0.00%
5	红利发放	2017年10月12日	2,555.53	0.00	0.00%
6	红利发放	2017年10月13日	2,985.78	0.00	0.00%
7	红利发放	2017年10月16日	9,005.29	0.00	0.00%
8	红利发放	2017年10月17日	2,861.35	0.00	0.00%
9	红利发放	2017年10月18日	3,267.99	0.00	0.00%
10	红利发放	2017年10月19日	2,798.45	0.00	0.00%
11	红利发放	2017年10月20日	2,788.85	0.00	0.00%
12	红利发放	2017年10月23日	8,328.94	0.00	0.00%
13	红利发放	2017年10月24日	2,781.69	0.00	0.00%
14	红利发放	2017年10月25日	2,780.23	0.00	0.00%
15	红利发放	2017年10月26日	2,793.66	0.00	0.00%
16	红利发放	2017年10月27日	2,872.93	0.00	0.00%
17	红利发放	2017年10月30日	8,375.10	0.00	0.00%
18	红利发放	2017年10月31日	2,785.80	0.00	0.00%
19	红利发放	2017年11月1日	2,800.32	0.00	0.00%
20	红利发放	2017年11月2日	2,836.41	0.00	0.00%
21	红利发放	2017年11月3日	2,848.96	0.00	0.00%
22	申购	2017年11月6日	6,000,000.00	6,000,000.00	0.00%
23	红利发放	2017年11月6日	8,518.04	0.00	0.00%
24	红利发放	2017年11月7日	3,470.78	0.00	0.00%
25	红利发放	2017年11月8日	3,499.61	0.00	0.00%
26	红利发放	2017年11月9日	3,479.76	0.00	0.00%
27	红利发放	2017年11月10日	3,461.85	0.00	0.00%
28	红利发放	2017年11月13日	10,404.22	0.00	0.00%
29	红利发放	2017年11月14日	3,429.08	0.00	0.00%
30	红利发放	2017年11月15日	3,444.51	0.00	0.00%
31	红利发放	2017年11月16日	4,017.75	0.00	0.00%
32	申购	2017年11月17日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
33	红利发放	2017年11月17日	5,610.89	0.00	0.00%
34	红利发放	2017年11月20日	26,898.71	0.00	0.00%
35	红利发放	2017年11月21日	11,891.08	0.00	0.00%
36	红利发放	2017年11月22日	9,069.66	0.00	0.00%
37	红利发放	2017年11月23日	9,056.41	0.00	0.00%
38	红利发放	2017年11月24日	9,082.64	0.00	0.00%
39	红利发放	2017年11月27日	27,324.65	0.00	0.00%
40	红利发放	2017年11月28日	10,818.52	0.00	0.00%
41	红利发放	2017年11月29日	9,045.66	0.00	0.00%
42	红利发放	2017年11月30日	9,089.82	0.00	0.00%
43	红利发放	2017年12月1日	8,984.98	0.00	0.00%
44	红利发放	2017年12月4日	27,077.83	0.00	0.00%
45	红利发放	2017年12月5日	9,048.39	0.00	0.00%
46	红利发放	2017年12月6日	8,981.66	0.00	0.00%
47	红利发放	2017年12月7日	11,696.29	0.00	0.00%
48	红利发放	2017年12月8日	9,033.39	0.00	0.00%
49	红利发放	2017年12月11日	26,989.86	0.00	0.00%
50	红利发放	2017年12月12日	12,971.69	0.00	0.00%
51	红利发放	2017年12月13日	12,709.55	0.00	0.00%
52	红利发放	2017年12月14日	12,783.32	0.00	0.00%
53	红利发放	2017年12月15日	13,157.78	0.00	0.00%
54	红利发放	2017年12月18日	27,838.98	0.00	0.00%
55	红利发放	2017年12月19日	9,357.33	0.00	0.00%
56	红利发放	2017年12月20日	12,476.93	0.00	0.00%
57	红利发放	2017年12月21日	9,532.85	0.00	0.00%
58	红利发放	2017年12月22日	9,312.49	0.00	0.00%
59	红利发放	2017年12月25日	28,096.46	0.00	0.00%
60	红利发放	2017年12月26日	9,447.66	0.00	0.00%
61	红利发放	2017年12月27日	13,889.40	0.00	0.00%
62	红利发放	2017年12月28日	9,664.97	0.00	0.00%
63	红利发放	2017年12月29日	9,683.66	0.00	0.00%
64	赎回	2017年12月29日	-4,000,000.00	-4,000,000.00	0.00%
合计			56,559,067.27	56,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件