



4. 债券投资组合构建

本基金的债券组合主要作为基金流动性管理和规避股票市场系统性风险的工具。

债券投资策略包括：自上而下的策略、深入分析宏观政策、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

主要分三个层面：

◆自上而下的宏观投资策略：本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策以及制度变化的动向，把握相关领先指标，通过计量经济模型进行综合评估，预测未来利率变动走势，为债券资产配置提供策略支持，并且及时把握制度变化产生的机会。

◆债券资产配置策略：在预测未来利率走势基础上，依据债券的利率期限结构、风险特征、流动性、久期和凸性，对不同品种、不同品种的债券进行合理的资产配置，构建投资组合，并随投资环境的变化及时调整。

① 市场配置：银行间债券市场和交易所债券市场投资比例，将综合考虑债券收益率以及流动性进行配置和调整。

② 品种选择：基于流动性和收益性考虑，主要投资成为成熟、流动性较好的国债与金融债。对于企业债将综合考虑信用评级等级和赋税条件等指标；对于可转债将评估其转换条款和偿债公司的成长性，以分享股价上升带来的高收益。

③ 期限结构：将在短期、中期、长期债券中进行组合，达到久期和凸性管理的目的，控制利率风险。

④ 构建投资组合：债券投资组合的构建与调整是一个自上而下的过程，通过综合评价个券收益率、流动性、到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素，并运用金融工程技术和短期利率收益率曲线、套息率曲线选择投资策略；以下原则：① 分散投资；② 顺势品种的发行集中度；③ 一级市场交易的集中度；④ 单个品种的收益率和基准确收益率曲线的偏离。

5. 权证投资

◆权证作为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。根据有关规定，本基金投资权证应遵循下述投资比例限制：

◆本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

◆本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的百分之三。

◆本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1. 资产配置决策

由投资决策委员会向基金经理提出大类资产配置和其他重大投资事宜的指导性意见，基金经理按照该指导性意见，确定本基金资产的配置比例和其他重大投资方向。

2. 类别资产投资决策

基金经理在投资决策委员会资产配置比例范围内，根据前述各类资产的投资策略，分别进行股票、债券、货币市场工具、权证等资产类别的投资决策。

3. 股票投资决策

◆基金经理根据行业研究员的上市公司研究报告，并结合自身的分析判断，精选个股作为本基金的备选投资对象；

◆基金经理根据宏观研究员及策略研究员提供的研究报告，并结合自身的分析判断，在上述精选股票的基础上优化配置，构造本基金投资组合；

◆基金经理根据上市公司及行业基本面的变化以及对组合风险的评估，持续地对组合进行优化调整。

2. 基金业绩归因分析：债券研究员、金融工程研究员提供的研究报告，结合自身的分析判断，选择具体的债券、可转债、货币市场工具、权证品种构造投资组合。

3. 投资组合限制

根据目前法律法规的规定，以及本基金的投资策略，本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金将持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2. 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3. 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

4. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

5. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1. 资产配置决策

由投资决策委员会向基金经理提出大类资产配置和其他重大投资事宜的指导性意见，基金经理按照该指导性意见，确定本基金资产的配置比例和其他重大投资方向。

2. 类别资产投资决策

基金经理在投资决策委员会资产配置比例范围内，根据前述各类资产的投资策略，分别进行股票、债券、货币市场工具、权证等资产类别的投资决策。

3. 股票投资决策

◆基金经理根据行业研究员的上市公司研究报告，并结合自身的分析判断，精选个股作为本基金的备选投资对象；

◆基金经理根据宏观研究员及策略研究员提供的研究报告，并结合自身的分析判断，在上述精选股票的基础上优化配置，构造本基金投资组合；

◆基金经理根据上市公司及行业基本面的变化以及对组合风险的评估，持续地对组合进行优化调整。

2. 基金业绩归因分析：债券研究员、金融工程研究员提供的研究报告，结合自身的分析判断，选择具体的债券、可转债、货币市场工具、权证品种构造投资组合。

3. 投资组合限制

根据目前法律法规的规定，以及本基金的投资策略，本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金将持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2. 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3. 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

4. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

5. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1. 资产配置决策

由投资决策委员会向基金经理提出大类资产配置和其他重大投资事宜的指导性意见，基金经理按照该指导性意见，确定本基金资产的配置比例和其他重大投资方向。

2. 类别资产投资决策

基金经理在投资决策委员会资产配置比例范围内，根据前述各类资产的投资策略，分别进行股票、债券、货币市场工具、权证等资产类别的投资决策。

3. 股票投资决策

◆基金经理根据行业研究员的上市公司研究报告，并结合自身的分析判断，精选个股作为本基金的备选投资对象；

◆基金经理根据宏观研究员及策略研究员提供的研究报告，并结合自身的分析判断，在上述精选股票的基础上优化配置，构造本基金投资组合；

◆基金经理根据上市公司及行业基本面的变化以及对组合风险的评估，持续地对组合进行优化调整。

2. 基金业绩归因分析：债券研究员、金融工程研究员提供的研究报告，结合自身的分析判断，选择具体的债券、可转债、货币市场工具、权证品种构造投资组合。

3. 投资组合限制

根据目前法律法规的规定，以及本基金的投资策略，本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金将持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2. 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3. 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

4. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

5. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1. 资产配置决策

由投资决策委员会向基金经理提出大类资产配置和其他重大投资事宜的指导性意见，基金经理按照该指导性意见，确定本基金资产的配置比例和其他重大投资方向。

2. 类别资产投资决策

基金经理在投资决策委员会资产配置比例范围内，根据前述各类资产的投资策略，分别进行股票、债券、货币市场工具、权证等资产类别的投资决策。

3. 股票投资决策

◆基金经理根据行业研究员的上市公司研究报告，并结合自身的分析判断，精选个股作为本基金的备选投资对象；

◆基金经理根据宏观研究员及策略研究员提供的研究报告，并结合自身的分析判断，在上述精选股票的基础上优化配置，构造本基金投资组合；

◆基金经理根据上市公司及行业基本面的变化以及对组合风险的评估，持续地对组合进行优化调整。

2. 基金业绩归因分析：债券研究员、金融工程研究员提供的研究报告，结合自身的分析判断，选择具体的债券、可转债、货币市场工具、权证品种构造投资组合。

3. 投资组合限制

根据目前法律法规的规定，以及本基金的投资策略，本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金将持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2. 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3. 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

4. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

5. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1. 资产配置决策

由投资决策委员会向基金经理提出大类资产配置和其他重大投资事宜的指导性意见，基金经理按照该指导性意见，确定本基金资产的配置比例和其他重大投资方向。

2. 类别资产投资决策

基金经理在投资决策委员会资产配置比例范围内，根据前述各类资产的投资策略，分别进行股票、债券、货币市场工具、权证等资产类别的投资决策。

3. 股票投资决策

◆基金经理根据行业研究员的上市公司研究报告，并结合自身的分析判断，精选个股作为本基金的备选投资对象；

◆基金经理根据宏观研究员及策略研究员提供的研究报告，并结合自身的分析判断，在上述精选股票的基础上优化配置，构造本基金投资组合；

◆基金经理根据上市公司及行业基本面的变化以及对组合风险的评估，持续地对组合进行优化调整。

2. 基金业绩归因分析：债券研究员、金融工程研究员提供的研究报告，结合自身的分析判断，选择具体的债券、可转债、货币市场工具、权证品种构造投资组合。

3. 投资组合限制

根据目前法律法规的规定，以及本基金的投资策略，本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金将持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2. 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3. 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

4. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

5. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1. 资产配置决策

由投资决策委员会向基金经理提出大类资产配置和其他重大投资事宜的指导性意见，基金经理按照该指导性意见，确定本基金资产的配置比例和其他重大投资方向。

2. 类别资产投资决策

基金经理在投资决策委员会资产配置比例范围内，根据前述各类资产的投资策略，分别进行股票、债券、货币市场工具、权证等资产类别的投资决策。

3. 股票投资决策

◆基金经理根据行业研究员的上市公司研究报告，并结合自身的分析判断，精选个股作为本基金的备选投资对象；

◆基金经理根据宏观研究员及策略研究员提供的研究报告，并结合自身的分析判断，在上述精选股票的基础上优化配置，构造本基金投资组合；

◆基金经理根据上市公司及行业基本面的变化以及对组合风险的评估，持续地对组合进行优化调整。

2. 基金业绩归因分析：债券研究员、金融工程研究员提供的研究报告，结合自身的分析判断，选择具体的债券、可转债、货币市场工具、权证品种构造投资组合。

3. 投资组合限制

根据目前法律法规的规定，以及本基金的投资策略，本基金的投资组合将遵循以下限制：

1. 本基金将持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2. 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的10%；

3. 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

4. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

5. 本基金管理人管理的基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，不受上述条款限制。

2. 投资决策

本基金投资实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

① 承销证券；

② 向他人贷款或者提供担保；

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 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

⑥ 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

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 投资未经中国证监会批准的的非公开发行证券，或预付任何形式的保证金；

⑨ 法律法规及基金合同规定禁止从事的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金不受上述限制。

业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

1. 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	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
2	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
3	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
4	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
5	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
6	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
7	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
8	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
9	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46
10	600036	招商银行	2,594,408,443.93	74.46

2. 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	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1010106	11央行票据06	1,450,000	140,128,000.00
2	010107	21国债07	610,350	65,600,418.00
3	113002	工行转债	409,000	43,542,140.00
4	113001	中行转债	409,000	37,832,000.00
5	100041	09国债04	300,000	30,813,000.00

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

本基金报告期末未有资产支持证券。

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五名权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

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

本基金报告期末未有权证。

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权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

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权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

10. 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

本基金报告期末未有权证。

11. 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

本基金报告期末未有权证。

12. 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

本基金报告期末未有权证。

13. 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

本基金报告期末未有权证。

14. 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

本基金报告期末未有权证。

15. 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

本基金报告期末未有权证。

16. 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

本基金报告期末未有权证。

17. 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

本基金报告期末未有权证。

18. 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

本基金报告期末未有权证。

19. 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

本基金报告期末未有权证。

20. 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

本基金报告期末未有权证。

21. 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

本基金报告期末未有权证。

22. 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

本基金报告期末未有权证。

23. 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

本基金报告期末未有权证。

24. 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

本基金报告期末未有权证。

25. 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

本基金报告期末未有权证。

26. 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

本基金报告期末未有权证。

27. 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

本基金报告期末未有权证。

28. 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

本基金报告期末未有权证。

29. 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

本基金报告期末未有权证。

30. 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

本基金报告期末未有权证。

31. 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

本基金报告期末未有权证。

32. 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

本基金报告期末未有权证。

33. 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

本基金报告期末未有权证。

34. 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

本基金报告期末未有权证。

35. 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

本基金报告期末未有权证。

36. 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

本基金报告期末未有权证。

37. 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

本基金报告期末未有权证。

38. 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

本基金报告期末未有权证。

39. 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

本基金报告期末未有权证。

40. 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

本基金报告期末未有权证。

41. 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

本基金报告期末未有权证。

42. 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

本基金报告期末未有权证。

43. 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

本基金报告期末未有权证。

44. 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

本基金报告期末未有权证。

45. 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

本基金报告期末未有权证。

46. 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

本基金报告期末未有权证。

47. 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

本基金报告期末未有权证。

48. 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

本基金报告期末未有权证。

49. 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

本基金报告期末未有权证。

50. 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

本基金报告期末未有权证。

51. 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

本基金报告期末未有权证。

52. 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

本基金报告期末未有权证。

53. 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

本基金报告期末未有权证。

54. 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

本基金报告期末未有权证。

55. 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

本基金报告期末未有权证。

56. 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

本基金报告期末未有权证。

57. 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

本基金报告期末未有权证。

58. 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

本基金报告期末未有权证。

59. 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

本基金报告期末未有权证。

60. 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

本基金报告期末未有权证。

61. 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

本基金报告期末未有权证。

62. 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

本基金报告期末未有权证。

63. 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

本基金报告期末未有权证。

64. 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

本基金报告期末未有权证。

65. 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

本基金报告期末未有权证。

66. 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

本基金报告期末未有权证。

67. 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

本基金报告期末未有权证。

68. 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

本基金报告期末未有权证。

69. 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

本基金报告期末未有权证。

70. 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

本基金报告期末未有权证。

71. 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

本基金报告期末未有权证。

72. 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

本基金报告期末未有权证。

73. 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

本基金报告期末未有权证。

74. 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

本基金报告期末未有权证。

75. 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

本基金报告期末未有权证。

76. 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

本基金报告期末未有权证。

77. 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

本基金报告期末未有权证。

78. 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

本基金报告期末未有权证。

79. 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

本基金报告期末未有权证。

80. 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

本基金报告期末未有权证。

81. 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

本基金报告期末未有权证。

82. 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

本基金报告期末未有权证。

83. 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

本基金报告期末未有权证。

84. 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

本基金报告期末未有权证。

85. 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

本基金报告期末未有权证。

86. 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

本基金报告期末未有权证。

87. 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

本基金报告期末未有权证。

88. 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

本基金报告期末未有权证。

89. 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

本基金报告期末未有权证。

90. 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

本基金报告期末未有权证。

91. 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

本基金报告期末未有权证。

92. 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

本基金报告期末未有权证。

93. 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

本基金报告期末未有权证。

94. 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

本基金报告期末未有权证。

95. 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

本基金报告期末未有权证。

96. 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

本基金报告期末未有权证。

97. 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

本基金报告期末未有权证。

98. 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

本基金报告期末未有权证。

99. 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

本基金报告期末未有权证。

100. 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

本基金报告期末未有权证。

101. 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

本基金报告期末未有权证。

102. 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

本基金报告期末未有权证。

103. 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

本基金报告期末未有权证。

104. 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

本基金报告期末未有权证。

105. 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

本基金报告期末未有权证。

106. 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

本基金报告期末未有权证。

8. 其他

9. 合计

494,283,943.20

14.28

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	1010106	11央行票据06	1,450,000	140,128,000.00	4.05
2	010107	21国债07	610,350	65,600,418.00	1.90
3	113002	工行转债	409,000	43,542,140.00	1.26
4	113001	中行转债	409,000	37,832,000.00	1.09
5	100041	09国债04	300,000	30,813,000.00	0.89

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

本基金报告期末未有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

9. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

本基金报告期末未有权证。

10. 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

本基金报告期末未有权证。

11. 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</