

诺安增利债券型证券投资基金

2012 年度 报告 摘要

100指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证行业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板权重交易型开放式指数证券投资基金及诺安中小板权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

| 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介 |  |                              |        |  |
|------------------------------|--|------------------------------|--------|--|
| 姓名                           | 职务   | 任本基金的基金经理(助理)期限<br>任职日期 离任日期 | 证券从业年限 | 说明   |
| 汪洋                           | 诺安增利债券型证券投资基金基金经理、诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2011年12月14日 -                | 2      | 硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商银行总行，从事债券投资工作。2011年7月加入诺安基金管理有限公司，任基金经理助理。于2011年12月起任诺安增利债券型证券投资基金基金经理、诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。于2012年11月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

注：①此处的任职日期和离任日期为公司作出决定并对外公告之日；  
②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。  
4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
报告期内，诺安增利债券型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规，遵守了《诺安增利债券型证券投资基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度，本基金投资运作未发生违法违规行为。

4.3 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1 公平交易制度的控制方法  
根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外研究报告均通过该研究管理平台发布，并确保该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价申报限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例拆分到各投资组合；对于场外债券一级市场申购、非公开发行交易等集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易所对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则确保各投资组合获得公平的交易价格。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
本报告期，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。此外，公司对连续四个季度期间内，公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内的同向交易的交易价差进行了分析，未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本基金于报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同一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%的交易次数为4，均是由于公司旗下个别基金使用量化投资策略所致。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析  
2012年，外围市场反复波折，欧美经济复苏，美联储持续量化宽松，同时，国内经济持续回落，全年通胀一路走低，在年初4.5%下行至1.7%，年底反弹至2.5%；全年CPI持续下降，从年初的1.1%下行至年底的7.9%。整个2012年，央行在年中两次降息，进入第四季度后开始通过公开市场操作微调流动性。市场资金面在年末基本平稳，只是在年底受年底提前备款等因素影响，一度飙升。国内股市年内大部分时间走势低迷，但在第四季度强烈反弹；债券市场去年持续上涨，全年维持为牛市形态；可转债市场随股市同向运动，转债指数表现略输大盘。报告期内，我们采取稳健的投资策略，稳住了高票息信用债投资，分散了债券久期，调整了一部分转债仓位。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至报告期末诺安增利债券A基金份额净值为1.083元，本报告期基金份额净值增长率为3.74%；截至报告期末诺安增利债券B基金份额净值为1.064元，本报告期基金份额净值增长率为3.20%；业绩比较基准中债带全债指数收益率为4.03%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望2013年，外围市场仍保持牛市形态，国内经济方面，经济增速仍保持下行趋势，但有望在一、二季度见底，CPI第一季度不具备大幅上行动力，但后期有一定上行空间，货币政策宽松，不排除央行动用降准手段调控市场，货币市场利率仍会保持在低位。债券市场方面，利率债、高等级信用债仍有交易性机会，高票息信用债将面临信用风险局面，年内不排除有信用事件发生，应加强对信用风险的管理，股市反弹或可持续，转债指数股市走将有机会，但品种选择需要细致。2013年我们将奉行稳健投资原则，积极寻找债市、股市中的投资机会。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明  
报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务和基金份额计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人及本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中度和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，并且不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议调整某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。  
4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明  
在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为十二次，每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的20%；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。  
本基金本报告期内未进行利润分配。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明  
2012年，本基金托管人在对诺安增利债券型证券投资基金的托管过程中，严格恪守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的相关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  
2012年，诺安增利债券型证券投资基金的托管人——诺安基金管理有限公司在诺安增利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回的价格计算、基金费用开支等事项上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，诺安增利债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实性、准确和完整发表意见  
一、诺安基金依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安增利债券型证券投资基金2012年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 审计报告  
国富浩华会计师事务所（特殊普通合伙）及其经办注册会计师李英、胡立新于2013年3月15日出具了国浩审字【2013】227A0015号“无保留意见”审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表  
会计主体：诺安增利债券型证券投资基金  
报告截止日：2012年12月31日  
单位：人民币元

| 资产       | 本期末<br>2012年12月31日 | 上年度末<br>2011年12月31日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 资产：      |                    |                     |
| 银行存款     | 6,388,537.67       | 3,852,257.95        |
| 结算备付金    | 386,595.74         | 732,343.65          |
| 存出保证金    | 250,000.00         | 250,000.00          |
| 交易性金融资产  | 96,771,753.40      | 119,339,690.70      |
| 其中：股票投资  | -                  | -                   |
| 基金投资     | -                  | -                   |
| 债券投资     | 96,771,753.40      | 119,339,690.70      |
| 资产支持证券投资 | -                  | -                   |
| 衍生金融资产   | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产 | 1,600,000.00       | 3,240,282.96        |
| 应收证券清算款  | 1,974,280.17       | 1,683,455.11        |
| 应收利息     | -                  | -                   |
| 应收申购款    | 31,011.70          | 368,365.07          |
| 递延所得税资产  | -                  | -                   |
| 其他资产     | -                  | -                   |
| 资产总计     | 107,402,178.68     | 129,466,395.44      |

| 负债和所有者权益   | 本期末<br>2012年12月31日 | 上年度末<br>2011年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 负债：        |                    |                     |
| 短期借款       | -                  | -                   |
| 交易性金融负债    | -                  | -                   |
| 衍生金融负债     | -                  | -                   |
| 卖出回购金融资产款  | 24,600,000.00      | 36,599,730.00       |
| 应付证券清算款    | 1,768,916.29       | 1,579,681.63        |
| 应付赎回款      | 52,004.32          | 56,797.98           |
| 应付管理费      | 14,858.36          | 16,228.02           |
| 应付销售服务费    | 7,020.31           | 8,300.98            |
| 应付交易费用     | 1,857.19           | 3,707.45            |
| 应交税费       | 247,645.80         | 17,519.12           |
| 应付利息       | 17,744.95          | -                   |
| 应付利润       | -                  | -                   |
| 递延所得税负债    | -                  | -                   |
| 其他负债       | 451,328.08         | 350,554.93          |
| 负债合计       | 27,161,375.30      | 38,632,520.15       |
| 所有者权益：     |                    |                     |
| 实收基金       | 74,419,940.83      | 87,261,669.85       |
| 未分配利润      | 5,820,862.55       | 3,572,205.46        |
| 所有者权益合计    | 80,240,803.38      | 90,833,875.31       |
| 负债和所有者权益总计 | 107,402,178.68     | 129,466,395.44      |

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额总额74,419,940.83份，其中：A级基金份额净值1.083元，B级基金份额净值1.064元。

基金份额56,060,712.39份；B级基金份额净值1.064元，基金份额18,359,228.44份。  
7.2 利润表  
会计主体：诺安增利债券型证券投资基金  
本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日  
单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |
|-----------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 一、收入                  | 6,082,005.37                | 117,982.60                       |
| 1.利息收入                | 4,864,406.36                | 4,524,082.65                     |
| 其中：存款利息收入             | 83,937.23                   | 85,801.08                        |
| 债券利息收入                | 4,780,469.13                | 4,304,208.08                     |
| 资产支持证券利息收入            | -                           | -                                |
| 买入返售金融资产收入            | -                           | 134,073.49                       |
| 其他利息收入                | -                           | -                                |
| 2.投资收益(损失以“-”填列)      | 154,280.24                  | -6,019,456.23                    |
| 其中：股票投资收益             | -                           | -1,603,812.43                    |
| 基金投资收益                | -                           | -                                |
| 债券投资收益                | 154,280.24                  | -4,425,183.80                    |
| 资产支持证券投资              | -                           | -                                |
| 衍生工具收益                | -                           | -                                |
| 股利收益                  | -                           | 9,540.00                         |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 915,929.87                  | 1,561,427.33                     |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)     | -                           | -                                |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)     | 147,388.90                  | 51,928.85                        |
| 减：二、费用                | 2,738,573.79                | 2,697,014.57                     |
| 1.管理人报酬               | 635,148.20                  | 848,025.41                       |
| 2.托管费                 | 181,470.89                  | 242,293.03                       |
| 3.销售服务费               | 95,812.37                   | 137,066.80                       |
| 4.交易费用                | 6,566.17                    | 358,588.36                       |
| 5.利息支出                | 1,376,109.98                | 688,889.97                       |
| 其中：卖出回购金融资产支出         | 1,376,109.98                | 688,889.97                       |
| 6.其他费用                | 443,466.18                  | 422,151.00                       |
| 7.利润总额(亏损总额以“-”号填列)   | 3,343,431.58                | -2,579,031.97                    |
| 减：所得税费用               | -                           | -                                |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)     | 3,343,431.58                | -2,579,031.97                    |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表  
会计主体：诺安增利债券型证券投资基金  
本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日  
单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 所有者权益合计        |
|--|-----------------------------|----------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 87,261,669.85               | 3,572,205.46   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                           | 3,343,431.58   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -12,841,729.02              | -1,094,774.49  |
| 其中：1.基金申购款                             | 694,472,392.46              | 47,476,015.22  |
| 2.基金赎回款                                | -707,314,121.48             | -48,570,789.71 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                           | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 74,419,940.83               | 5,820,862.55   |

| 项目                                     | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 所有者权益合计        |
|--|-----------------------------|----------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 177,188,372.09              | 10,766,779.97  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                           | -2,579,031.97  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -89,926,702.24              | -4,615,542.54  |
| 其中：1.基金申购款                             | 334,331,168.08              | 16,150,994.35  |
| 2.基金赎回款                                | -424,257,870.32             | -20,766,536.89 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                           | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 87,261,669.85               | 3,572,205.46   |

报表附注为财务报表的组成部分。  
本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：  
奥成文 薛有为  
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人  
7.4.1 报表附注所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明  
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。  
7.4.2 差错更正的说明  
本基金本报告期无差错更正。  
7.4.3 关联方关系  
关联方名称 与本基金的关系

|                |                     |
|----------------|---------------------|
| 中国对外经济贸易信托有限公司 | 管理人股东               |
| 深圳市捷隆投资有限公司    | 管理人股东               |
| 大恒新纪元科技股份有限公司  | 管理人股东               |
| 诺安基金管理有限公司     | 发起人、管理人、注册登记机构、销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司   | 托管人                 |
| 中国中化股份有限公司     | 管理人股东母公司            |

注：下述关联方交易均在正常业务范围内，按一般商业条款订立。  
7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易  
7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易  
7.4.4.1.1 股票交易  
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。  
7.4.4.1.2 权证交易  
本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。  
7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金  
本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。  
7.4.4.2 关联方报酬  
7.4.4.2.1 基金管理费  
单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 635,148.20                  | 848,025.41                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 197,924.34                  | 283,958.88                       |

注：A.基金管理费按前一日的基础资产净值的0.70%的年费率计提，计算方法如下：  
H=E×0.70%/当年天数  
H为每日应计提的基金的管理费  
E为前一日的基础资产净值  
B.基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。  
7.4.4.2.2 基金托管费  
单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 181,470.89                  | 242,293.03                       |

注：A.基金托管费按前一日的基础资产净值的0.20%的年费率计提，计算方法如下：  
H=E×0.20%/当年天数  
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日的基础资产净值  
B.基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。  
7.4.4.3 销售服务费  
单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称    | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 合计        |
|-------------------|-----------------------------|-----------|
| 诺安增利债券A           | 诺安增利债券B                     |           |
| 诺安基金管理有限公司（管理人）   | 19,689.96                   | 19,689.96 |
| 中国工商银行股份有限公司（托管人） | 33,803.13                   | 33,803.13 |
| 合计                | 53,493.09                   | 53,493.09 |

| 获得销售服务费的各关联方名称    | 本期<br>2011年1月1日至2011年12月31日 | 合计        |
|-------------------|-----------------------------|-----------|
| 诺安增利债券A           | 诺安增利债券B                     |           |
| 诺安基金管理有限公司（管理人）   | 7,128.91                    | 7,128.91  |
| 中国工商银行股份有限公司（托管人） | 56,239.62                   | 56,239.62 |
| 合计                | 63,368.53                   | 63,368.53 |

注：A. B级基金销售服务费按前一日的B级基金资产净值的0.45%的年费率计提。计算方法如下：H=E×0.45%/当年天数  
H为B级基金份额每日应计提的销售服务费  
E为前一日B级基金份额的基金资产净值  
B. 基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构。  
7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易  
本基金于本报告期及上年度可比期间与基金托管人无银行间同业市场的债券（含回购）交易。  
7.4.4.4 关联方投资本基金的情况  
7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本报告期及上年度可比期间基金管理人没有运用固有资金投资本基金。  
7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况  
本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金的情况。  
7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入  
单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |
|--------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 6,388,537.67                | 69,066.71                        |
| 期末余额         | 3,852,257.95                | 57,215.12                        |

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。  
7.4.4.7 其他关联交易事项的说明  
本基金无其他关联交易事项。  
7.4.5 期末 2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券  
7.4.5.1 因认购新发增发行券而于期末持有的流通受限证券  
本基金本报告期末不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限证券。  
7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
本基金本报告期末未有暂时停牌等流通受限股票。  
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券  
7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2012年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元，无债券作为质押。  
7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末2012年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额24,600,000.00元，分别于2013年1月4日和1月7日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

| § 8 投资组合报告     |                   |                |              |
|----------------|-------------------|----------------|--------------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 |                   |                |              |
| 序号             | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
| 1              | 权益投资              | -              | -            |
| 其中：股票          | -                 | -              | -            |
| 2              | 固定收益投资            | 96,771,753.40  | 90.10        |
| 其中：债券          | 96,771,753.40     | 90.10          |              |
| 资产支持证券         | -                 | -              | -            |
| 3              | 买入返售金融资产          | -              | -            |
| 4              | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 5              | 银行存款和结算备付金合计      | 6,775,133.41   | 6.31         |
| 6              | 其他各项资产            | 3,855,291.87   | 3.59         |
| 7              | 合计                | 107,402,178.68 | 100.00       |

| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                 |  |  |  |
|------------------------------------|--|--|--|
| 本基金本报告期末未有股票。                      |  |  |  |
| 8.3 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 |  |  |  |
| 本基金本报告期末未有股票。                      |  |  |  |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                |  |  |  |
| 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 |  |  |  |
| 本基金本报告期未进行股票交易。                    |  |  |  |
| 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 |  |  |  |
| 本基金本报告期未进行股票交易。                    |  |  |  |
| 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额          |  |  |  |
| 本基金本报告期未进行股票交易。                    |  |  |  |
| 8.5 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          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券       | 14,585,106.50 | 18.18        |
| 2  | 央行票据       | -             | -            |
| 3  | 金融债券       | 5,004,500.00  | 6.24         |
| 4  | 企业债、政策性金融债 | 5,004,500.00  | 6.24         |
| 5  | 中期票据       | 71,037,331.30 | 88.53        |
| 6  | 企业短期融资券    | -             | -            |
| 7  | 可转债        | -             | -            |
| 8  | 其他         | 6,144,815.60  | 7.66         |
| 9  | 合计         | 96,771,753.40 | 120.60       |

| 8.6 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)   |
| 1                                  | 122686 | 12国债06 | 100,000 |
| 2                                  | 019027 | 10国债27 | 100,000 |
| 3                                  | 122949 | 09国债07 | 75,690  |
| 4                                  | 122965 | 09国债08 | 67,000  |
| 5                                  | 112068 | 11国债08 | 50,000  |

| 8.7 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                                       |  |  |  |
|--|--|--|--|
| 本基金本报告期未有资产支持证券。   |  |  |  |
| 8.8 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   |  |  |  |
| 本基金本报告期未有权证。   |  |  |  |
| 8.9 投资组合报告附注   |  |  |  |
| 8.9.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。 |  |  |  |
| 8.9.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定股票库之外的股票。                                    |  |  |  |
| 8.9.3 期末其他各项资产构成   |  |  |  |

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 250,000.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,600,000.00 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,974,280.17 |
| 5  | 应收申购款   | 31,011.70    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,855,291.87 |

| 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 |        |      |              |
|--------------------------|--------|------|--------------|
| 序号                       | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         |
| 1                        | 110018 | 国电转债 | 3,307,360.00 |