

中海稳健收益债券型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

大多数样本通过相关检验。6)对2013年上半年所有组合间向交易的交易占优情况进行了统计,在双向交易采集样本数大于30个的前提下,日内3日、5日的期间窗口下,部分组合对比的统计值未满足交易占优比45%-55%的比例。需要指出的是,组合间向交易的样本数越大,组合之间的交易占优情况满足交易占优比45%-55%的比例越高。4)对于不同时间期间的同组合反向交易,公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析,未发现异常情况。不同时间期间的不同组合的反向交易,公司根据交易价格、交易频率、交易数量进行了综合分析,未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
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 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年上半年经济与物价逐步回落,市场对于经济增长的判断由最初复苏预期逐步减弱为底部徘徊的结论。经济基本面和市场情绪的相成变化构成了债券市场运行的基础。

3)进入二季度后,逐月公布的宏观经济数据显示宏观经济持续疲弱,6月月份制造业PMI数据为例,中采PMI指数创4个月新低,汇丰PMI指数创9个月新低。物价数据连续数月在低位徘徊,显示经济复苏疲弱的特征。流动性方面,外汇占款的减少,监管部门对理财产品的监管,投资机构一季度时的普遍高杠杆等多重因素叠加使得二季度后市场流动性偏紧。政府 盘活存量,用好增量”的表态充分表明货币政策不会再过度宽松。央行发表严控资金风险,加强金融中介机构内部流动性管理能力的言论,资金紧张的程度在六月达到阶段性高点,拆借利率一度创下历史新高,受上述因素影响,债券市场出现明显调整,各期限信用品种收益率普遍上行,同时收益率曲线呈现明显平坦化。

在上半年的操作中,我们对债券市场继续保持谨慎乐观态度。出于对经济数据阶段性好转的判断,一季度时增配了部分可转债品种和高收益信用品种,二季度时出于对经济持续回落和货币中性政策的判断,保持信用债现有仓位,降低了可转债品种持仓比例。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2013年6月30日,本基金份额净值1.051元(累计净值1.331元)。报告期内本基金净值增长率为32.26%,高于业绩比较基准1.11个百分点。
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
未来的经济增速和物价走势以及政府宏观政策走向是对债券市场最为重要的影响因素。中国经济在下半年是否继续在底部徘徊,物价水平是否继续保持在低位,央行货币政策是否继续保持中性态度,市场流动性是否会出现阶段性高点高度紧张情况,上述问题将是市场持续关注的焦点。从国内宏观经济背景看,政府对于经济增长和结构之间的平衡抉择和政策方向也将直接影响市场中不同类别资产的价格走势。

对于上述因素我们要保持实时跟踪,我们在未来的运作仍将坚持稳健谨慎原则,根据市场环境动态调整仓位和资产配置。
4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照新准则,中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规规定履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所负责在估值调整等导致基金资产净值变化的20%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告,定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了解确保估值工作的顺利开展,建立了负责估值工作决策和执行的估值委员会,小组成员包括督察长,风险控制总监,监察稽核负责人及基金会计负责人,小组成员均具有多年基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理,但对于非活跃投资品种,投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据法律法规及本基金合同的相关规定,本基金于2013年2月28日实施了利润分配,实际分配金额为12,423,167.91元。
5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,本基金托管人在对中海稳健收益债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,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
本报告期内,中海稳健收益债券型证券投资基金的托管人——中海基金管理有限公司在中海稳健收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格遵循基金合同的约定进行。本报告期,中海稳健收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为12,423,167.91元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海稳健收益债券型证券投资基金2013年半年度报告中的财务指标、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 半年度财务指标(未经审计)

Table with 2 columns: 资产, 负债和所有者权益. Rows include 银行存款, 交易性金融资产, 可供出售金融资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 2 columns: 资产, 负债. Rows include 交易性金融资产, 可供出售金融资产, 其他资产, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上期. Rows include 一、期初所有者权益, 二、本期经营活动产生的基金净值变动数, etc.

注:本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。
6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发增发证券而于期末持有的流通受限证券
注:本基金在本报告期未买入因认购新发增发证券而持有流通受限证券。
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
注:本基金在本报告期未持有暂时停牌等流通受限股票。
6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额,因此无抵押债券。
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额,因此无抵押债券。

7.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元
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 139,967,997.80 97.23
其中:债券 139,967,997.80 97.23
资产支持投资 -- --
3 金融衍生品投资 -- --
4 买入返售金融资产 -- --
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 1,357,200.69 0.94
6 其他各项资产 2,632,268.66 1.83
7 合计 143,957,467.15 100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
7.3 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
注:本基金本报告期末未持有股票。
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 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
金额单位:人民币元
序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)
1 600521 华海药业 24,500.00 0.01
注:本报告期内累计买入股票金额是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,不考虑相关交易费用。
7.4.2 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
金额单位:人民币元
序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)
1 600521 华海药业 32,600.00 0.01
注:本报告期内,累计卖出股票金额是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元
买入股票成本(成交)总额 24,500.00
卖出股票收入(成交)总额 32,600.00
注:本报告期内,买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额(成交单价乘以成交数量)列示的,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元
序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 国家债券 -- --
2 央行票据 -- --
3 金融债券 9,945,000.00 6.94
其中:政策性金融债 9,945,000.00 6.94
4 企业债券 111,800,784.20 78.05
5 企业短期融资券 -- --
6 中期票据 -- --
7 可转债 -- --
8 其他 -- --
9 合计 139,967,997.80 97.71

7.6 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
金额单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 1180038 11博望债 200,000 20,704,000.00 14.45
2 126019 09长债债 120,520 10,974,551.20 7.66
3 1280263 12华商东泰债 100,000 10,369,000.00 7.24
4 1180100 11清河投资债 100,000 10,149,000.00 7.09
5 112101 12安泰债 100,000 10,060,000.00 7.02

7.7 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.8 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
7.9 投资组合报告附注
7.9.1 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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
7.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券中不存在在基金合同规定备选股票库之外的股票。
7.9.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元
序号 名称 金额
1 存出保证金 23,952.61
2 应收证券清算款 -- --
3 应收股利 -- --
4 应收利息 2,607,016.05
5 应收申购款 -- --
6 其他应收款 1,300.00
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 2,632,268.66

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
金额单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 113003 重工转债 5,516,287.20 3.85
2 120015 石化转债 6,695,336.40 2.58
3 110020 南山转债 3,297,030.00 2.30
4 410022 同仁转债 1,555,560.00 1.09

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。
7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
8 基金份额持有人信息
8.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份
持有人户数 户均持有的基金份额 持有人结构
机构投资者 个人投资者
持有份额 占总份额比例 持有份额 占总份额比例
2,321 58,729.59 55,695,423.93 40.86% 80,615,912.12 59.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
项目 持有份额总数(份) 占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金 22,435.28 0.0165%
注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门从业人员持有本基金总份额的数量区间为0;本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。
9 开放式基金份额变动
单位:份
基金合同生效日(2008年4月10日)基金份总额 2,592,754,388.85
本报告期初基金份额总额 247,880,118.33
本报告基金总申购份额 129,970,161.72
本报告基金总赎回份额 241,538,905.00
本报告基金拆变动份额 -- --
本报告期末基金份额总额 136,311,375.05

10.1 基金份额持有人大会决议
本报告期内未召开基金份额持有人大会。
10.2 基金经理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
10.4 基金投资策略的改变
本报告期内本基金投资策略未有重大变化。
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
为本基金审计的会计师事务所为江苏公证天业会计师事务所有限公司,本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本报告期内本基金管理人、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及债券支付情况
金额单位:人民币元
券商名称 股票交易 债券交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.3 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.4 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.5 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.6 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.7 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.8 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.9 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额
申银万国 333,091,866.96 93.98% 797,400,000.00 100.00% -- -- -- -- -- -- -- -- -- --
华泰证券 21,322,694.48 6.02% -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- -- --

10.7.10 基金租用证券公司交易单元进行其他投资的情况
金额单位:人民币元
券商名称 债券交易 股票交易 权证交易
成交金额 成交金额 成交金额 成交金额 成交金额 成交金额 成交金额