

信诚添金分级债券型证券投资基金

2013 第四季度报告

4 基金管理人报告

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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
王国强	本基金基金经理、信诚理财7日盈禧半年有定期理财基金基金经理	2012年12月12日 -	14	管理学硕士，14年证券、基金从业经验。曾任任职于浙江国际信托投资公司、德隆证券股份有限公司和银华基金管理有限公司。2006年加入信诚基金管理有限公司，现任信诚理财7日盈禧基金经理、信诚添金分级债券基金基金经理。兼任定期开放债券基金的基金经理。
王旭巍	本基金基金经理、信诚添金分级债券基金基金经理、信诚基金副首席投资官、固定收益	2013年1月15日 -	19	经济学硕士，19年金融、证券、基金从业经验。曾任任职于中国工商银行(深圳)物资工业集团有限公司大连期货部、达达期货经纪有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、2010年加盟信诚基金管理有限公司，现任公司副首席投资官、固定收益

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
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》的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》、《信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生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
根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司制定的《信诚基金公平交易管理制度v1.2》，公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各前、中、后台在公平交易执行中各司其职，投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。建立公平交易的制度环境；交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保不同基金在一、二级市场同时一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以了严格的后台监控，公平评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内，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。
报告期内，未出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5%的交易。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
四季度经济增长延续弱势回升态势，物价小幅上行，在总需求仍偏偏弱的情形下，通胀压力不大。货币政策偏紧，市场流动性紧张，利率市场改革持续推进进而影响四季度资金利率继续向上攀升，总体水平已达到了历史高位，导致债市四季度债券市场大幅下跌。债券市场规范整顿，一级市场需求不足，四季度债券供给偏多，供需不平衡导致一级市场利率上行，固定收益类产品种类繁多，债市资金流出较多等诸多因素加剧了债券市场下跌态势。本季度产业债信用风险较为突出，部分行业和领域的企业经营出现恶化，信用评级下调，收益率大幅上升。债市四季度期间投资收益率较低，标普全债指数下跌1.2%。
四季度，本基金持仓以企业债、公司债、短期融资券等信用债为主，组合久期维持较低水平，规避利率波动风险。2013年9月12日，本基金季季添金份额第三次打开，赎回金额10.3亿元，导致本基金在本季度出现杠杆再次上升。本基金在2013年杠杆二次被调大的过程中，

坚持积极的减仓策略，降低投资风险，首先是减持长久期债券，缩短久期，降低利率波动风险；其次是降低信用风险，通过严格的内部信用评级体系，甄别信用风险，减持信用风险较高的债券品种，清出信用风险较为突出的行业的债券，如钢铁、电解铝、煤化工等行业的债券；再次是减持风险溢价低、性价比相对较低的品种，如铜债、可转债投资较为审慎，参与较少。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内基金份额净值增长率为-3.65%，同期业绩比较基准收益率为-1.20%，基金表现落后后基准2.45个百分点。

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	固定收益投资	768,728,741.86	71.24
其中：国债投资	768,728,741.86	71.24	
资产支持证券	-	-	-
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	28,832,113.99	26.30
6	其他资产	26,477,377.48	2.45
7	合计	1,079,029,333.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。
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
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	49,950,000.00	5.44
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
其中：政策性金融债	-	-	-
4	企业债	708,550,910.50	77.19
5	中期票据	9,756,000.00	1.06
7	可转债	471,831.36	0.05
8	其他	-	-
9	合计	768,728,741.86	83.74

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十名债券投资明细

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	019113	11国债13	500,000	49,950,000.00	5.44
2	124215	13国债15	500,000	49,950,000.00	5.44
3	124051	12庆高新	399,990	41,530,960.70	4.52
4	122891	10通江债	380,640	36,236,928.00	3.95
5	124019	12江证债	35,809,689.60	3,90	

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

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十名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资范围不包括股指期货投资。
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
本基金投资范围不包括国债期货投资。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期内未进行国债期货投资。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金投资范围不包括国债期货投资。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 本基金本报告期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。
5.10.2 本基金本报告期的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。
5.10.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	1,023,498.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,453,878.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预付费	-
9	合计	26,477,377.48

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
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
本基金本报告期末未持有股票。
5.10.6 因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

5.6 开放式基金份额变动

项目	信诚季季添金	信诚岁岁添金
报告期期初基金份额总额	359,604,330.60	927,215,054.39
报告期期间基金总申购份额	488,091,560.88	90,090,853.36
减：报告期期间基金总赎回份额	210,477,772.24	733,668,931.25
报告期期间基金净申购/赎回份额(份额减少以“-”填列)	3,765,500.73	-8,928,909.44
报告期期末基金份额总额	640,983,623.17	274,707,267.06

注：根据《信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同》、《信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书》、《信诚基金关于信诚添金分级债券型证券投资基金基金估值核算业务的操作指引》及《中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定》，本基金管理人于2013年12月12日(折算基准日)，2013年12月10日(折算基准日)分别对本基金季季添金基金份额、岁岁添金基金份额进行了基金份额折算。
5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。
5.8 备查文件目录

- 备查文件目录
- 1.信诚添金分级债券型证券投资基金相关批准文件
- 2.信诚基金管理有限公司营业执照、公司章程
- 3.信诚添金分级债券型证券投资基金基金合同
- 4.信诚添金分级债券型证券投资基金招募说明书
- 5.本报告期内按照规定披露的各项公告
- 8.2 存放地点
信诚基金管理有限公司办公地——上海市浦东新区世纪大道9号上海国金中心汇丰银行大楼9层。
- 8.3 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.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2014年1月21日

信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)

2013 第四季度报告

4 基金管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
杨建标	本基金基金经理、信诚先锋精选股票基金基金经理	2012年8月28日 -	12	理学硕士，12年证券基金从业经验。历任华泰证券股份有限公司资产管理总部投资经理助理、平安证券有限责任公司综合研究所行业研究员、生命人寿股份有限公司投资管理研究中心总监、渤海基金管理有限责任公司(筹)投资管理部负责人。2010年3月加入信诚基金管理有限公司，担任投资经理，现任信诚先锋精选股票基金及信诚新机遇股票基金(LOF)基金的基金经理。

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
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》的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚新机遇股票型证券投资基金基金合同》、《信诚新机遇股票型证券投资基金LOF的招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生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
根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司制定的《信诚基金公平交易管理制度v1.2》，公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各前、中、后台在公平交易执行中各司其职，投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。建立公平交易的制度环境；交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保不同基金在一、二级市场同时一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以了严格的后台监控，公平评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内，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。
报告期内，未出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5%的交易。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2013年四季度，欧美股市在良好的经济增长大幅上行，即便是美联储宣布量化宽松政策退出计划也没有影响到市场的良好表现，A股市场则受到资金紧张的压制，市场波动，十八届三中全会决定公布后市场预期一度兴奋，但在IPO重启和中央利率飙升的打击下再度反复。结构上，家用电器、农林牧渔、交运设备、纺织服装、机械装备表现较好；信息服务、有色金属、商贸贸易、房地产、采掘表现落后。
四季度，本基金坚持适度持有工业自动化、信息设备、医药生物、交运设备，确保符合经济增长大型方向的中优质企业，排除一些高污染高耗能个股，取得了较好的投资收益。
展望明年，转型升级、改革仍然是最重要的投资背景，投资主线和个股机会依然必须围绕两个主题而展开寻找：与此同时，利率难以迅速下降，个股难以大幅宽松，可能造成趋势性的行情，甚至到2013年—样性的行业机会都难以出现；但长期来看，传统经济转型升级也是大势所趋，唯有其基本面可能继续支撑，然而由于中国经济仍然具有较强韧性，传统经济股基本面再度大幅转差的可能性也不大，这就约束了市场大幅下跌的空间；此外，改革难以一蹴而就，势必会影响到投资人的情绪从而导致市场振荡。综合这些因

素分析，我们判断2014年市场波动较大，但幅度不大，投资机会仍然集中在消费服务、环保、健康产业、移动互联网应用、工业自动化等优势表现转型升级的行业和公司改革主题上，不过投资机会不是行业性的，而是集中在优质的、有持续业绩增长的公司上。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内基金份额净值增长率为4.71%，同期业绩比较基准收益率为-2.81%，基金表现领先基准1.52个百分点。

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	99,812,221.97	81.85
2	固定收益投资	99,812,221.97	81.85
其中：债券	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
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	21,916,557.99	17.97
6	其他资产	21,888.57	0.18
7	合计	121,947,663.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	77,588,535.00	67.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,567,039.60	3.12
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	717,852.60	0.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,556,960.00	4.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,691,134.77	9.35
O	公共管理、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	体育和娱乐业	1,690,700.00	1.48
S	合计	99,812,221.97	87.29

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300124	汇川技术	193,977	11,345,714.73	9.92
2	300070	德米科技	260,823	10,691,134.77	9.35
3	000915	山大华特	335,500	10,303,205.00	9.01
4	000215	海康威视	430,000	9,881,400.00	8.64
5	000581	威远生物	6,991,600.00	6.11	
6	002034	威尔药业	5,262,000.00	4.60	
7	600887	伊利股份	110,000	4,298,800.00	3.76
8	000025	长安汽车	350,000	4,007,500.00	3.50
9	000516	开元投资	603,560	3,567,039.60	3.12
10	002236	大华股份	77,387	3,163,580.56	2.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。
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
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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
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
本基金投资范围不包括国债期货投资。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期内未进行国债期货投资。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金投资范围不包括国债期货投资。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1 本基金本报告期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。
5.10.2 基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。
5.10.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	63,859.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,478.84
5	应收申购款	150,544.80
6	其他应收款	-
7	预付费	-
9	合计	218,883.57

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
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
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
因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。
5.6 开放式基金份额变动

项目	信诚新机遇股票基金	信诚新双盈分级债券基金
报告期期初基金份额总额	92,924,379.97	1,115,491,038.17
报告期期间基金总申购份额	4,059,971.62	-
减：报告期期间基金总赎回份额	9,777,457.54	-
报告期期间基金净申购/赎回份额(份额减少以“-”填列)	87,206,890.05	-
报告期期末基金份额总额	87,206,890.05	-

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。
5.8 备查文件目录

- 备查文件目录
- 1.信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)相关批准文件
- 2.信诚基金管理有限公司营业执照、公司章程
- 3.信诚新机遇股票型证券投资基金(LOF)基金合同
- 4.信诚新机遇股票型证券投资基金基金(LOF)招募说明书
- 5.本报告期内按照规定披露的各项公告
- 8.2 存放地点
信诚基金管理有限公司办公地——上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层。
- 8.3 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.xcfunds.com。

信诚基金管理有限公司
2014年1月21日

信诚新双盈分级债券型证券投资基金

2013 第四季度报告

4 基金管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
王旭巍	本基金基金经理、信诚添金分级债券基金基金经理、信诚基金副首席投资官、固定收益	2013年5月9日 -	19	经济学硕士，19年金融、证券、基金从业经验。曾任任职于中国工商银行(深圳)物资工业集团有限公司大连期货部、达达期货经纪有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、2010年加盟信诚基金管理有限公司，现任公司副首席投资官、固定收益

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
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》的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同》、《信诚新双盈分级债券型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生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
根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司制定的《信诚基金公平交易管理制度v1.2》，公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各前、中、后台在公平交易执行中各司其职，投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。建立公平交易的制度环境；交易环节加强交易执行的内部控制，利用恒生交易系统公平交易相关程序，及其它的流程控制，确保不同基金在一、二级市场同时一证券交易时的公平；公司同时不断完善和改进公平交易分析系统，在事后加以了严格的后台监控，公平评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内，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。
报告期内，未出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5%的交易。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2013年四季度，受流动性冲击影响7天回购利率中债攀升至4.5%左右，居高不下，债券收益率继续大幅上行。主要有以下几个原因：(1)央行实行控制增量，盘活存量，把好流动性总闸门，政策取向明确，使得市场预期一致。(2)央行反通胀，银行间、银行、财政支出控制严格，财政赤字投放导致的流动性低于往年。(3)三季度以来基建投资大幅、房地产销售火爆，融资需求旺盛，在信贷收紧、信贷紧缩高峰下，债券融资需求持续放大，资金通过非标准信贷渠道增加。(4)债券基金赎回压力较大，债券各品种在四季度末，久期下降，品种上集中，信用债供给更大，期限上来看，中短期期限更大，评级上来看，低评级债供给更大。

注：1.基金合同生效日起至披露时点不满一年本基金合同生效日为2013年5月9日。
2、本基金建仓期自2013年5月9日至2013年11月8日，按照基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起不超过6个月内完成建仓，建仓结束后资产配置比例符合本基金基金合同规定。
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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	固定收益投资	1,491,947,441.60	90.42
其中：国债投资	1,491,947,441.60	90.42	
资产支持证券	-	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	65,200,000.00	3.95
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	14,415,034.32	0.87
6	其他资产	78,495,716.19	4.61
7	合计	1,650,058,192.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。
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
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	-	-
其中：政策性金融债	-	-	-
4	企业债	1,415,156,810.24	88.66
6	中期票据	70,527,000.00	4.42
7	可转债	6,263,631.36	0.39
8	其他	-	-
9	合计	1,491,947,441.60	93.47

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十名债券投资明细

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		--	--
	其中：政策性金融债		--	--