

## 德邦景颐债券型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

利益。在本报告期内,本基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,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》及公司内部制度,公平对待所管理的不同基金财产,在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节,未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

## 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人未发现本基金存在异常交易行为,不存在有损投资者利益的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金在报告期内的业绩表现如下:截至2018年6月30日,本基金A类份额净值为1.1911元,本基金B类份额净值为1.1181元,本基金C类份额净值为1.1181元,本基金B类份额净值增长率为-2.15%。

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 现金及银行存款	19,888,000.00	10.48
2 衍生工具	-	-
3 固定收益投资	150,599,000.00	79.19
4 企业债	-	-
5 企业短期债券	-	-
6 中期票据	-	-
7 可转债(可交换)	-	-
8 国企债	-	-
9 其他	-	-
10 合计	169,477,000.00	89.64

## 5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券品种 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券	国债	500,000	50,015,000.00	26.38
2 企业债	企业债	400,000	40,020,000.00	21.11
3 固定收益	固定收益	300,000	30,024,000.00	15.84
4 中期票据	中期票据	200,000	20,000,000.00	10.55
5 企业短期债券	企业短期债券	200,000	19,899,000.00	10.48

## 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五名贵金属投资明细

序号 贵金属品种 贵金属名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金	金	14,315,069.00	754
2 银	银	5,598,375.00	295
3 其他	其他	-	-
4 合计	合计	18,940,445.00	100.00

## 5.4 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股票投资组合

序号 证券代码 证券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600104	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75
2 600030	中国银行	130,000	40,000,000.00	21.11
3 600031	中国平安	13,000	30,024,000.00	15.84
4 600032	中国人寿	17,000	20,000,000.00	10.55
5 600036	招商银行	19,000	19,899,000.00	10.48

## 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 债券品种 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券	国债	500,000	50,015,000.00	26.38
2 企业债	企业债	400,000	40,020,000.00	21.11
3 固定收益	固定收益	300,000	30,024,000.00	15.84
4 中期票据	中期票据	200,000	20,000,000.00	10.55
5 企业短期债券	企业短期债券	200,000	19,899,000.00	10.48

## 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贵金属投资明细

序号 贵金属品种 贵金属名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金	金	14,315,069.00	754
2 银	银	5,598,375.00	295
3 其他	其他	-	-
4 合计	合计	18,940,445.00	100.00

## 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股票投资明细

序号 证券代码 证券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600104	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75
2 600030	中国银行	130,000	40,000,000.00	21.11
3 600031	中国平安	13,000	30,024,000.00	15.84
4 600032	中国人寿	17,000	20,000,000.00	10.55
5 600036	招商银行	19,000	19,899,000.00	10.48

## 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权证投资明细

序号 权证品种 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600030	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75
2 600031	中国平安	13,000	30,024,000.00	15.84
3 600032	中国人寿	17,000	20,000,000.00	10.55
4 600036	招商银行	19,000	19,899,000.00	10.48
5 600104	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75

## 5.9 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股票投资明细

序号 证券代码 证券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600104	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75
2 600030	中国银行	130,000	40,000,000.00	21.11
3 600031	中国平安	13,000	30,024,000.00	15.84
4 600032	中国人寿	17,000	20,000,000.00	10.55
5 600036	招商银行	19,000	19,899,000.00	10.48

## 5.10 报告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 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 128021	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75
2 128022	中行国际	130,000	40,000,000.00	21.11
3 128023	中行国际	13,000	30,024,000.00	15.84
4 128024	中行国际	17,000	20,000,000.00	10.55
5 128025	中行国际	19,000	19,899,000.00	10.48

## 5.11 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

序号 权证品种 权证名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600104	中行国际	17,000	7,000,000.00	3.75
2 600030	中国银行	130,000	40,000,000.00	21.11