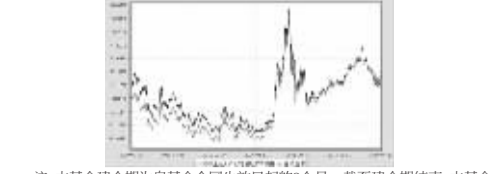


# 交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 2018年第三季度报告

投资业绩比较基准: 上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2018年9月29日至2018年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例约定。

### 4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李倩	基金经理	2018-12-27	-	12年	李倩女士,中国国籍,复旦大学工商管理专业硕士,曾任招商证券资产管理部副经理,2018年12月27日加入交银施罗德基金担任本基金基金经理。2019年1月1日起兼任交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注:基金经理 (或基金经理小组) 期间变动: (如有) 敬请关注基金管理人发布的相关公告。  
4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明  
在报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他相关法律法规的规定,并未有被监管机构、司法机关等处罚和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.3 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.4 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.5 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.6 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.7 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.8 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.9 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.10 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.11 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.12 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.13 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.14 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.15 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.16 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.17 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.18 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.19 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.20 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.21 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.22 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.23 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.24 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.25 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.26 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.27 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.28 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.29 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.30 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.31 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.32 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.33 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

4.3.34 公平交易制度的执行情况  
本公司建立了严格的投资控制制度和公平交易控制制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所有管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

格化,优先"比例分配"的原则,全部通过交易系统按行比例分配;对于非盘中竞价交易,以公司名义进行的外交交易,遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益差异、分投资类别的收益差异以及不同时间窗口向交易的交易价差进行分析,通过评估分析和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情况,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口 (如日内、3日内、5日内) 同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析  
2018年第三季度国内经济增速趋缓,与此对应的托底政策也不断出台,但受到中美贸易摩擦反复加剧、美元加息、汇率波动等因素带来的负面影响,三季度A股市场波动加大,表现阶段性下行。作为跟踪基准指数的指数基金,三季度基金总体呈现出震荡的走势。

展望下一季度,我们认为通胀仍将维持温和,货币中性稳健,财政政策持续发力,中美贸易摩擦的影响在短期或仍将延续,政策的短期重点或偏向于稳增长的方向,市场经历了二季度到三季度的调整,许多行业指数已接近合理估值区间,目前股价已包含了二季度到三季度的预期,总体而言,从中长期来看我们对A股市场仍维持谨慎中性的看法。

4.5 报告期内基金的业绩表现  
本基金 (各券) 份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标"及"3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较"部分披露。

4.6 报告期内本基金持有的人数或基金资产净值区间说明  
本基金本报告期内无需专项说明。

5 投资组合报告  
5.1 报告期末基金资产组合情况  
1 权益投资 4,997,079.38 1.34  
其中:股票 4,997,079.38 1.34  
2 基金投资 379,586,346.61 93.02  
3 固定收益投资 -- --  
其中:债券投资 -- --  
资产支持证券 -- --  
4 贵金属投资 -- --  
5 衍生金融资产 -- --  
6 买入返售金融资产 -- --  
7 银行存款和结算备付金合计 22,917,500.06 5.71  
8 其他资产 491,943,348.31 100.00  
9 合计 491,943,348.31 100.00

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 报告期末按行业分类的债券投资组合  
5.3.1 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债券投资明细  
1 国债 1,000,000.00 0.26  
2 国债 1,000,000.00 0.26  
3 国债 1,000,000.00 0.26  
4 国债 1,000,000.00 0.26  
5 国债 1,000,000.00 0.26  
6 国债 1,000,000.00 0.26  
7 国债 1,000,000.00 0.26  
8 国债 1,000,000.00 0.26  
9 国债 1,000,000.00 0.26  
10 国债 1,000,000.00 0.26

5.3.2 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。

5.3.3 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  
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.3.4 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  
本基金本报告期末未持有权证。

5.3.5 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股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

5.3.7 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境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

5.3.8 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

5.3.9 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

5.3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.3.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.12 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

5.3.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

5.3.14 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

5.3.15 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

5.3.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.3.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.18 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

5.3.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

5.3.20 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

5.3.21 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

5.3.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.3.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.24 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

5.3.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

5.3.26 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

5.3.27 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

5.3.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.3.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.30 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

5.3.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

5.3.32 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

5.3.33 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

5.3.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.3.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.3.36 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

6.1 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	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	601318	中国平安	12,000	863,300.00	0.22
2	600036	招商银行	12,000	396,200.00	0.10
3	601166	兴业银行	14,500	231,250.00	0.06
4	600000	浦发银行	13,400	144,420.00	0.04
5	601398	工商银行	25,000	142,200.00	0.04
6	600014	上汽集团	4,100	136,480.00	0.03
7	601968	宝钢股份	24,200	123,550.00	0.03
8	601091	中信银行	3,700	131,300.00	0.03
9	601390	中国银行	16,800	130,560.00	0.03
10	600000	浦发银行	7,700	126,180.00	0.03

6.2 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  
本基金本报告期末未持有债券。

6.3 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  
本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4 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  
本基金本报告期末未持有权证。

6.5 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股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

6.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

6.7 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境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

6.8 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

6.9 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

6.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

6.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

6.12 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

6.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

6.14 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

6.15 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

6.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

6.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

6.18 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

6.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

6.20 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

6.21 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

6.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

6.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

6.24 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

6.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

6.26 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

6.27 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71

6.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

6.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

6.30 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期权投资明细  
本基金本报告期末未持有期权。

6.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名境外证券投资明细  
本基金本报告期末未持有境外证券。

6.32 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银行存款投资明细  
1 银行存款 2,800,000.00 0.71  
2 银行存款 2,800,000.00 0.71  
3 银行存款 2,800,000.00 0.71  
4 银行存款 2,800,000.00 0.71  
5 银行存款 2,800,000.00 0.71

6.33 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债券回购投资明细  
1 国债回购 2,800,000.00 0.71  
2 国债回购 2,800,000.00 0.71  
3 国债回购 2,800,000.00 0.71  
4 国债回购 2,800,000.00 0.71  
5 国债回购 2,800,000.00 0.71