(上接B112版)

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金合同生效日(2018年12月19日)持有的基金份额	3,637,405.62
报告期初持有的基金份额	3,637,405.62
报告期间申购/买入总份额	–
报告期间因拆分变动份额	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–
报告期末持有的基金份额	3,637,405.62
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.7132%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.8.4.2 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

无。

7.4.8.5 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 2018年12月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	547,457.07	1,528.88

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.8.1.1 受限证券类别:股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额		备注
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–		–
7.4.8.1.2 受限证券类别:债券											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额		备注
152053	18吴中债	2018-12-25	2019年1月8日	新债流通受限	100.00	100.00	110,000	11,000,000.00	11,000,000.00		–
152054	18众鑫01	2018-12-24	2019年1月22日	新债流通受限	100.00	100.00	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00		–
7.4.8.1.3 受限证券类别:权证											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额		备注
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–		–

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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33,400,000.00元,于2019年01月02日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为240,359,310.10元,无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日(基金合同失效前日),本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体:鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月18日

单位:人民币元

资 产		本期末 2018年12月18日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		543,218.20	580,921.17
结算备付金		866,532.60	117,653.38
存出保证金		3,515.82	8,896.40
交易性金融资产		123,989,148.80	18,874,685.30
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		123,989,148.80	18,874,685.30
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	3,800,000.00
应收证券清算款		7,198,496.73	6,227.84
应收利息		2,559,848.34	338,544.68
应收股利		–	–
应收申购款		–	51,312.90
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		135,160,759.49	23,778,231.67
负债和所有者权益		本期末 2018年12月18日	上年度末 2017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		23,100,000.00	–
应付证券清算款		2,069,509.40	–
应付赎回款		5,094,282.71	10,748.23
应付管理人报酬		17,319.61	5,996.59
应付托管费		11,546.43	3,997.74
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		1,980.75	153.75
应交税费		10,869.63	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		180,331.76	370,004.00
负债合计		30,485,840.29	390,900.31
所有者权益:			
实收基金		71,991,008.87	17,658,678.53
未分配利润		32,683,910.33	5,728,652.83
所有者权益合计		104,674,919.20	23,387,331.36
负债和所有者权益总计		135,160,759.49	23,778,231.67

注: 报告截止日2018年12月18日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额104,674,918.98份。

7.2 利润表

会计主体:鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月18日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月18日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		4,633,454.44	1,655,278.29
1.利息收入		1,640,997.62	5,161,620.59
其中:存款利息收入		14,931.66	68,946.87
债券利息收入		1,602,242.84	4,969,639.11
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		23,823.12	123,034.61
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		301,911.30	-11,978,779.17
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		301,911.30	-11,978,779.17
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		–	–
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		2,663,349.86	8,356,310.56
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)		27,195.66	116,126.31
减:二、费用		559,953.60	1,726,460.54
1. 管理人报酬	7.4.7.2.1	108,966.68	475,396.09
2. 托管费	7.4.7.2.2	72,644.49	268,423.51
3. 销售服务费	7.4.7.2.3	–	–
4. 交易费用		7,091.59	8,434.00
5. 利息支出		91,830.61	707,199.63
其中:卖出回购金融资产支出		91,830.61	707,199.63
6. 税金及附加		5,260.99	–
7. 其他费用		274,159.24	267,007.31
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		4,073,500.84	-71,182.25
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		4,073,500.84	-71,182.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月18日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月18日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	17,658,678.53	5,728,652.83	23,387,331.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	4,073,500.84	4,073,500.84
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)	54,332,330.34	22,881,756.66	77,214,087.00
其中:1.基金申购款	79,794,385.41	33,998,826.24	113,793,211.65
2.基金赎回款	-25,462,055.07	-11,117,069.58	-36,579,124.65
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)	71,991,008.87	32,683,910.33	104,674,919.20
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	168,083,537.93	58,452,026.05	226,535,563.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-71,182.25	-71,182.25
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)	-150,424,859.40	-52,652,190.97	-203,077,050.37
其中:1.基金申购款	2,163,357.33	743,612.45	2,906,969.78
2.基金赎回款	-152,588,216.73	-53,395,803.42	-205,984,020.15
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)	17,658,678.53	5,728,652.83	23,387,331.36

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:		
邓召明	苏波	郝文高
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 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华实业债纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2013]98号《关于核准鹏华实业债纯债债券型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,316,026,519.96元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第194号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》于2013年5月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,317,313,904.29份基金份额,其中认购资金利息折合1,287,384.33份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

在本基金基金份额折算基准日(即2018年12月18日),基金管理人对鹏华实业债纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)进行基金份额折算和变更登记,转型为鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金(以下或称“鹏华永诚一年定期开放债券”)。原鹏华实业债纯债债券型证券投资基金的基金份额转为生效后的鹏华永诚一年定期开放债券型证券投资基金份额,转型后鹏华永诚一年定期开放债券以定期开放方式运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等。基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%;对实业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债企业债总指数×80%+中债国债总指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当在中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年12月31日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年12月18日(基金合同失效前日)止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月18日(基金合同失效前日)的财务状况以及2018年1月1日至2018年12月18日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.4.3 差错更正的说明

无。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1.本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

无。

7.4.7.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月18日			
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
国信证券	66,570,083.44	100.00	268,090,127.54	100.00

7.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月18日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
国信证券	856,472,000.00	100.00	5,625,000,000.00	100.00

7.4.7.1.4 权证交易

无。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月18日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	108,966.68	475,396.09
其中:支付销售机构的客户维护费	30,056.45	35,268.33

注:1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为0.30%,逐日计提,按月支付。日管理费＝前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月18日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	72,644.49	268,423.51

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为0.20%,逐日计提,按月支付。日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

7.4.7.2.3 销售服务费

无。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月18日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金合同生效日(2013年5月3日)持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	2,501,654.67	2,501,654.67
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	1,135,750.95	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	3,637,405.62	2,501,654.67
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.4750%	14.1667%

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.7.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

7.4.7.5 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 2018年1月1日至2018年12月18日			
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	543,218.20	9,451.14	580,921.17	19,299.04

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8 期末(2018年12月18日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月18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23,100,000.00元,于2018年12月19日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月18日(基金合同失效前日),本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为123,989,148.80元,无属于第一或第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次521,850.00元,第二层次18,352,835.30元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月18日(基金合同失效前日),本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)其他

除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告(转型后)

8.1 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	基金投资	–	–
3	固定收益投资	240,359,310.10	97.42
	其中:债券	240,359,310.10	97.42
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	100,000.00	0.04
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	1,413,989.67	0.57
8	其他各项资产	4,839,298.91	1.96
9	合计	246,712,598.68	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

无。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

8.5 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	7,327,162.80	3.44
	其中:政策性金融债	6,314,662.80	2.96
4	企业债券	161,167,157.30	75.65
5	企业短期融资券	32,195,300.00	15.11
6	中期票据	39,669,690.00	18.62
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	240,359,310.10	112.83

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

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	011802560	18大足国资SCP002	140,000	14,044,800.00	6.59
2	1480187	14温高新债02	204,160	12,766,124.80	5.99
3	1480262	14太仓港债	200,000	12,508,000.00	5.87
4	1580098	15阳江债	150,000	12,420,000.00	5.83
5	1480325	14襄高投债	200,000	12,382,000.00	5.81

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

无。

8.8 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贵金属投资明细

无。

8.9 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

无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.11.3 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	3,515.82
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,835,783.09
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,839,298.91

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 投资组合报告(转型前)

8.1 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	基金投资	–	–
3	固定收益投资	123,989,148.80	91.73
	其中:债券	123,989,148.80	91.73
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	1,409,750.80	1.04
8	其他各项资产	9,761,859.89	7.22
9	合计	135,160,759.49	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

8.5 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	9,349,574.00	8.93
	其中:政策性金融债	8,337,574.00	7.97
4	企业债券	86,979,964.80	83.10
5	企业短期融资券	8,088,500.00	7.73
6	中期票据	19,571,110.00	18.70
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	123,989,148.80	118.45

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

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	1780139	17永州城投债	66,000	6,713,520.00	6.41
2	101800178	18新海连MTN001	65,000	6,659,250.00	6.36
3	041800345	18盐城高新CP001	65,000	6,566,300.00	6.27
4	127613	17淮南01	65,000	6,563,700.00	6.27
5	018005	国开1701	62,870	6,299,574.00	6.02

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

无。

8.8 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贵金属投资明细

无。

8.9 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

无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

8.11.3 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	3,515.82
2	应收证券清算款	7,198,495.73
3	应收股利	–
4	应收利息	2,559,848.34
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,761,859.89

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 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)	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