

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。
本报告期间为2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 泰达宏利货币
交易代码 162206
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2005年11月10日
报告期末基金份额总额 496,968,998.21份

投资目标 在确保本金安全性和基金资产流动性的基础上,力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略 本基金在遵守投资法律并有效管理风险的基础上,实施稳健的投资风格和谨慎的交易操作。以价值分析为基础,数量分析为支持,采用自上而下确定投资策略和自下而上精选证券的程序,运用财务分析、久期衡量、收益率曲线转换和资产配置等投资策略,实现基金资产的价值增值。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。
风险收益特征 本基金属于证券投资基金中低风险、低风险的品种,其预期收益水平和预期风险均低于股票、混合和债券型基金。

基金管理人 泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)
1. 本期已实现收益 5,837,787.37
2. 本期利润 5,837,787.37
3. 期末基金资产净值 496,968,998.21

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由证券市场基金采用摊余成本法计算,因此,公允价值变动收益为零。本期已实现收益和本期利润的金额单位为人民币元。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率(基准差), 业绩比较基准收益差, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④
过去三个月 0.9011% 0.0055% 0.7596% 0.0002% 0.1415% 0.0053%

注:本基金收益分配按日结转红利。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金成立于2005年11月10日,在建仓期结束时及截止报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理小组/简介

泰达宏利货币市场基金

2012 第三季度报告

Table with 5 columns: 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

胡剑飞 本基金基金经理 2008年8月9日 - 6
注: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,表中任职日期和离任日期均指公司做出决定的公告日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现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
本基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定。在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会,严格执行投资管理职能和执行执行的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可追溯;交易部门运用交易系统中的公平交易功能并实时监控优先、价格优先的原则严格执行所有指令,对于部分特殊一级市场申购,非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,交易部按照价格优先、比例分配的原则对申购结果进行分配,确保各投资组合享有公平的投资机会。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2012年3季度,欧债危机由于欧洲央行准备在二级市场买入危机国家债券等一系列举措得到有所平息,但前景依然曲折,欧洲经济继续恶化,美国房地产、制造业复苏较为明显,但失业率依然维持高位。美联储立场有所改变,为了增强通胀预期,9月份意外推出无限QE3。国内,经济继续处于探底过程中之中,但受制于通胀在7月底回升,房价连续多月反弹等原因,加上欧美等国家继续大幅量化宽松,货币政策发生微妙转变,货币政策较二季度回落至预期,投资再次成为稳增长的重要手段,发改委加快了基础设施项目的审批力度,稳增长预期有所回升。

4.4.2 报告期内基金的投资表现和业绩表现
截止报告期末,本基金份额净值为1.0400元,本报告期份额净值增长率为-1.52%,同期业绩比较基准增长率为-0.7596%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望三季度,货币政策2季度以来发生微妙变化,央行以公开市场逆回购的方式来调控市场资金状况,较高的央行逆回购利率使得银行间回购利率维持相对较高的水平。尽管目前利率大幅上升影响,各类短期债券在二季度调整幅度较大,央票、金融债收益率上升超过50bp,附近,而短债上升幅度则在80bp附近,Shibor浮动债表现依然较差。本基金3季度操作比较谨慎,除增持了部分金融债外,基本以减持为主,组合久期和持仓比例一度大幅下降。

4.6 投资组合报告
4.6.1 报告期末基金资产组合情况
报告期末,本基金资产组合如下:
1. 权益投资 1,133,053,688.23 (85.53%)
2. 固定收益投资 1,133,053,688.23 (85.53%)
3. 债券 1,133,053,688.23 (85.53%)
4. 资产支持证券 -
5. 金融衍生品投资 -
6. 买入返售金融资产 -
7. 其他 -
8. 合计 1,133,053,688.23 (85.53%)

4.6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔 - 0.00
B 采矿业 34,022,289.30 2.60
C 制造业 724,904,433.62 55.34
D 食品饮料 154,773,329.85 11.81
E 医药生物 11,048.76 0.00
F 信息技术 13,236,608.70 1.01
G 通信设备、仪器 39,928,392.64 3.05
H 批发和零售贸易 - 0.00
I 金融、保险 - 0.00
J 房地产业 - 0.00
K 其他服务业 25,657,586.29 1.96
L 传播文化产业 78,380,319.18 5.98
M 综合类 - 0.00
合计 1,133,053,688.23 86.50

4.6.3 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 002653 海思科 3,696,245 113,770,421.10 8.60
2 002065 东华软件 5,230,364 92,477,442.80 7.07
3 600809 山西汾酒 2,153,953 81,957,911.65 6.26
4 600535 天士力 1,321,149 67,959,904.56 5.19
5 300212 易华录 2,186,642 63,500,083.68 4.85
6 002475 立讯精密 2,028,878 62,469,153.62 4.77
7 600557 康缘药业 3,047,999 59,314,060.54 4.53
8 002273 水晶光电 2,277,309 48,620,547.15 3.71
9 000998 平潭高科 2,407,471 46,127,144.36 3.52
10 300058 蓝色光标 1,899,327 40,455,665.10 3.09

4.6.4 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债券投资明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券
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 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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。
5.8.8 投资组合报告附注
5.8.1 本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.8.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
5.8.3 其他资产构成
序号 项目 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 750,000.00
3 应收股利 -
4 应收利息 -
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 合计 1,001,356.45

5.8.4 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。
5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
5.8.6 报告期末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。
5.8.7 报告期末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