

鹏华实业债纯债债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2015年7月18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2015年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，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。
本基金的过往业绩并不预示其未来业绩。投资有风险，投资者作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务数据未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	鹏华实业债纯债债券基金
场内简称	
基金代码	000043
交易代码	000043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月27日
截至期末基金份额总额	40,408,480.08份
投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以实业类资产为主要投资方向，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金在资产配置上以实业类债券为主。一般情况下，当债券类资产中，实业类债券收益率高于国债、央行票据等其他债券的收益率，且实业类债券收益率与国债收益率的利差大于国债收益率时，本基金将适当增加实业类债券的配置比例；反之，当国债收益率高于实业类债券收益率时，本基金将适当减少实业类债券的配置比例。 2. 债券投资策略 本基金在债券投资策略上采取久期策略为主。一般情况下，当债券类资产中，实业类债券收益率高于国债、央行票据等其他债券的收益率，且实业类债券收益率与国债收益率的利差大于国债收益率时，本基金将适当增加实业类债券的配置比例；反之，当国债收益率高于实业类债券收益率时，本基金将适当减少实业类债券的配置比例。 3. 信用风险控制 本基金在信用风险控制上采取分散化投资策略。一般情况下，当债券类资产中，实业类债券收益率高于国债、央行票据等其他债券的收益率，且实业类债券收益率与国债收益率的利差大于国债收益率时，本基金将适当增加实业类债券的配置比例；反之，当国债收益率高于实业类债券收益率时，本基金将适当减少实业类债券的配置比例。
业绩比较基准	中债企业债总指数收益率×80%+中债国债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金、高于货币市场基金，为证券投资基金中具有中低风险收益特征的基金。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
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	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期（2015年4月1日—2015年6月30日）
1.本期已实现收益	3,003,078.82
2.本期公允价值变动收益	4,206,268.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.1121
4.期末基金资产净值	59,236,704.48
5.期末基金份额净值	1.461

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。
注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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

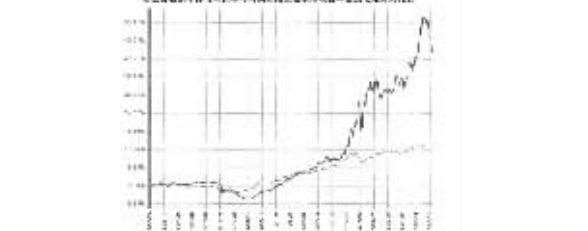
为上述基金业绩评价个因付付入以因以交易基金的各项费用（例如，付入基金中的申购赎回费、基金投资管理费）计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.03%	1.01%	2.90%	0.00%	7.03%	0.93%

注：业绩比较基准=中债企业债总指数收益率×80%+中债国债总指数收益率×20%
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1：本基金基金合同于2013年5月31日生效。
2.截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 基金经理（或基金经理小组）简介					
姓名	职务	任本基金基金经理期限	离任日期	证券从业年限	说明
刘太阳	本基金基金经理	2013年5月27日	-	9	刘太阳先生，国籍中国，理学硕士，9年金融证券从业经历，曾任鹏华基金管理有限公司市场部交易员，从事债券自营交易工作，2011年5月加入鹏华基金管理有限公司，从事债券研究工作，担任固定收益研究员，2012年5月起至今担任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理，2012年12月至2014年3月担任鹏华债券基金基金经理，2014年3月起至今担任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理，2015年6月起至今担任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理，2015年6月起至今担任鹏华实业债纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新设立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理暂行办法的相关规定。

3、基金经理刘太阳先生基金运用承诺如下：

报告期内，本基金基金经理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规，中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，诚实守信、勤勉尽责，不存在违反法律法规和基金合同、在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本期基金经理未发生任何不良记录，不存在违反法律法规和基金合同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 公平交易控制的情况

报告期内，本基金基金经理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在进行研究、交易、分配等各个环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生法律法规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期末本基金基金经理管理的投资组合参与的交易公开竞价日反向交易成交导致的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资运作和业绩表现

第二季度本基金基金管理人严格执行投资策略，报告期内本基金管理人严格执行投资策略，市场面资金面紧张，债券利率随流动性，自前期低点反弹并上行，债券市场供应能力有力加大，推动债券收益率回升。二季度来看，债券收益改善以流动性改善为主，中期票面利率和信用债利率随流动性加大。第二季度所有有价证券公允价值变动出现正收益的上述，其中信用债资产净值占比中短期固定收益类资产占比提升。

在二季度，基金净值经济周期及政策预期的判断，我们把握整体市场利率预期，密切跟踪利率变化，结合久期调整与资产配置，主要配置在期限以内的中短品种，其中信用品种以中高等级为主。此外，在第二季度，我们已调整了可转债的配置。

注1：任职日期和离任日期均指公告作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理的相关规定。
3.2 基金管理人及基金托管人根据法律法规及中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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
报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.3.2 投资交易行为的专项说明
报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人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超过该证券当日成交量的5%的情况。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内，国内经济增速持续下降，宏观政策宽松，市场资金面持续宽松，债券收益率继续回落，后期受地方债发行影响，债券市场流动性有所加大，推动债券收益率回升。全季度来看，债券收益以回落为主，其中中期债券收益率回落幅度最大。第二季度所有全价及净价数据均出现不同程度的上涨，其中企业债收益率涨幅最大，涨幅达3.08%。
4.4.2 报告期内基金业绩表现
本基金基金净值增长率79.93%，业绩比较基准为29.9%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望第二季度，虽然当前债券市场持续宽松，但商品库存仍处于高位，企业去库存压力依然较大，预计近期国内经济投资难以显著恢复，受财政收入增长缓慢影响，预计基建投资增长空间亦较为有限。在需求低迷、产能过剩和库存压力下，制造业投资继续面临下降压力。整体来看，三季度经济增速难以大幅回升，债券市场风险不大。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
注：无。

5.1 报告期末基金资产组合情况	§ 5 投资组合报告
基金管理人：鹏华基金管理有限公司 基金托管人：北京银行股份有限公司 报告送出日期：2015年7月18日	§ 1 重要提示
基金管理人及基金托管人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责任。 基金管理人及基金托管人根据基金合同规定，于2015年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，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。	

基金报告自2015年4月1日起至6月30日止。		基金产品简称
		《鹏华双债债券基金》
基金简称	鹏华双债	
场内简称	—	
基金代码	000143	
交易币种	人民币	
基金运作方式	契约型封闭式	
基金存续方式	定期开放式	
报告期末基金份额总额	110,240,622.71份	
投资目标	在严格控制信用风险,保持适度流动性的基础上,以企业债和可转债为主要投资标的,力争取得超越基金业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	1. 大类资产配置 本基金综合运用自上而下和自下而上的手段,在对宏观经济政策、货币金融政策、利率走势、通胀水平和估值水平进行研判的基础上,结合对股票市场和债券市场的表现和预期以及未来一段时期内各类资产的风险收益特征进行研判,决定本基金在股票、债券、货币等各类资产之间的资产配置比例,调整投资。	
	2. 债券资产配置 本基金债券资产主要投资于固定收益的利率债,在对宏观经济政策、货币政策、通胀预期、债券市场利率走势、信用利差、流动性状况、估值水平等因素进行综合研判的基础上,以企业债和可转债为主要投资标的,力争取得超越基金业绩比较基准的投资收益。	
	3. 股票资产配置 本基金股票资产主要投资于个股,并重点关注具有长期成长空间、业绩确定、估值合理的个股。在个股选择上,本基金主要投资于具有中长期成长空间、业绩确定、估值合理的个股。	
	4. 股指期货投资 本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,力争取得超越基金业绩比较基准的投资收益。	
	5. 融资融券投资 本基金在法律法规许可的情况下,将本着谨慎原则,充分研究论证,在有效控制风险的前提下,从定性和定量两个方面开展,上市公司融资能力。	
业绩比较基准	三年定期银行利率(税后)×1.2%	
风险收益特征	本基金为固定收益基金,其预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。其预期收益水平高于中低风险收益特征。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	

主要财务指标		§ 5.3 主要财务指标和基金净值变动		单位:人民币	
主要财务指标		报告期(2015年4月11日—2015年6月30日)		单位:人民币	
1.本期已实现收益		40,454,156.20			
2.本期利润		22,466,000.54			
3.加权平均基金份额本期利润		0.00654			
4.期末基金净值		122,138,042.00			
5.期末基金净值增长率		1.100			

注:1.本期已实现收益指基金本期股票投资收益、债券投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、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;

2.期末基金净值增长率不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购费、赎回费及销售服务费),计入费用后净值增长率;

3.基金净值增长率与业绩比较基准的差额及与同行业其他同类基金的比较

阶段	业绩增长率A	业绩比较基准增长率B	业绩比较基准增长率C	业绩比较基准增长率D	业绩比较基准增长率E	业绩比较基准增长率F
	①-③	②-④	③-⑤	④-⑥	⑤-⑦	⑥-⑦

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票。
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	120806	12国债06	300,000	24,918,000.00	41.89
2	041400046	14央行票据	100,000	10,104,000.00	17.03
3	122067	13国债07	70,000	7,140,000.00	12.03
4	123001	14央行票据	25,000	4,625,250.00	7.79
5	112031	11国债03	40,000	4,067,200.00	6.86

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债券投资明细
注：本基金本报告期末未持有债券投资。
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贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。
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五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。
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
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货交易。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未持有国债期货。
5.9.3 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交易。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
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。
5.10.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,166.71
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	7,128,283.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,150,450.72

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.8 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.9 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.10 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.11 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.12 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值计量资产。
5.10.13 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	102,690.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	5,675,140.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,780,831.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：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 报告期末本基金持有的公允价值高于成本的交易金融资产明细
注：本基金本报告期末未持有公允价值高于成本的交易金融资产。
5.10.6 报告期末本基金持有的其他公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有其他公允价值计量资产。
5.10.7 报告期末本基金持有的公允价值计量资产明细
注：本基金本报告期末未持有