

嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月16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。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	嘉实增强信用定期债券
基金代码	000005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月8日
报告期末基金份额总额	1,264,700,411.12份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期回报最大化,以求长期增值增值。
投资策略	本基金为固定收益类基金,坚持四好收益策略,即:选好资产、控制好期限、控制好信用、控制好流动性。本基金在严格控制风险的前提下,追求当期回报最大化,以求长期增值增值。本基金在严格控制风险的前提下,追求当期回报最大化,以求长期增值增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款基准利率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金及货币型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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
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	76,027,924.57
2.本期利润	72,740,054.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.05830
4.期末基金资产净值	1,310,052,982.43
5.期末基金份额净值	1.036

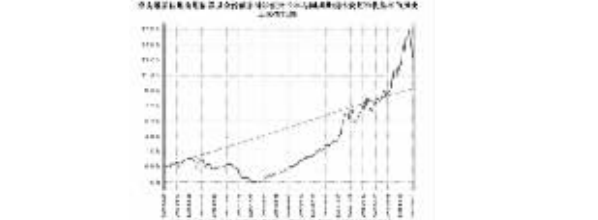
注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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%	净值增长率标准差%	业绩比较基准收益率%	业绩比较基准收益率标准差%	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月 4.70% 0.34% 0.89% 0.01% 3.00% 0.33%

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



图：嘉实增强信用定期债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

注:本基金合同所载说明书的目的,为基金自基金合同生效之日起每个会计年度末,建仓期结束对本基金的各项投资比例符合基金合同“第三部分(二)投资范围”和“投资限制”的有关约定。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理年限	证券从业年限	说明
姓名	职务	任本基金的基金经理年限	任本基金的基金经理年限	说明
刘宁	本基金、嘉实如意定期基金、嘉实如意信用定期基金基金经理	2013年3月8日	-	11年

注:(1)任职日期指本基金基金合同生效之日;(2)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。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,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,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.5.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.6 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.7 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.7.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.8 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.9 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.9.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.10 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.11 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.11.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.12 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.13 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.13.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.14 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.15 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.15.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.16 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.17 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.17.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.18 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.19 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.19.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.20 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.21 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.21.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数所致,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.22 报告期内本基金投资业绩的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.23 公平交易制度的执行情况
报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合投资决策和管理决策独立,并在获得投资信息、投资建议和投资建议决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行机制,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

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	-	-	-
B 采矿业	20,645,983.32	1.58	-
C 制造业	10,687,815.56	0.77	-
D 电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-	-
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	22,127,716.56	1.69	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 金融业	16,794,702.00	1.28	-
J 房地产业	19,722,043.46	1.51	-
K 租赁和商务服务业	-	-	-
L 科学研究和技术服务业	-	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
N 卫生、社会保障和福利业	-	-	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	-
P 教育	-	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	89,376,360.00	6.82	-

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	000089	深圳机场	1,361,477	22,127,716.56	1.69
2	600262	国际商贸	1,070,387	20,645,983.32	1.58
3	600016	民生银行	1,264,109	19,722,043.46	1.51
4	600037	北方华创	533,168	16,794,702.00	1.28
5	002408	齐翔腾达	688,564	10,687,815.56	0.77

注:报告期末,本基金仅持有上述5只股票。

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	111,202,000.00	8.49
4	央行票据及金融债	111,202,000.00	8.49
5	企业债	521,072,320.00	39.84
6	央行票据及金融债	393,063,000.00	29.80
7	中期票据	361,967,400.00	27.56
8	可转债	16,214,138.00	1.24
9	其他	-	-
合计	1,004,896,870.00	76.41	-

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	101472005	14国债05	720,000	73,346,400.00	5.60
2	150205	15国债05	600,000	58,482,000.00	4.46
3	140209	14国债09	500,000	52,720,000.00	4.02
4	10145011	14国债11	500,000	51,340,000.00	3.92
5	122840	12国债04	500,000	51,285,000.00	3.91

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组合

报告期末,本基金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贵金属投资组合
报告期末,本基金未持有贵金属投资。
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组合
报告期末,本基金未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	85,885.06
2	应收证券清算款	10,947,240.88
3	应收股利	-
4	应收利息	34,327,577.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计	45,360,703.87	-

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	惠泽转债	4,703,400.00	0.36
2	113501	海航转债	2,789,000.00	0.21