

## 嘉实增强收益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:招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  
基金管理人及董事承诺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。  
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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代表其未来表现。投资者有风险,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。  
本报告期内无涉及诉讼的财务资料未审计。  
本报告自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

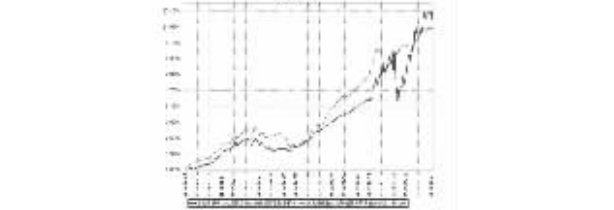
基金简称	嘉实增强收益定期债券
基金主代码	070033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月24日
报告期末基金份额总额	244,629,316.99份
投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期回报最大化,以谋求长期稳健增值。 在具备较多预期风险可控、收益率良好的投资标的时,优先考虑短期融资券及非AAA级别的其他信用债券的配置。同时,还可通过其他债券、衍生品等辅助投资策略,规避风险、增强收益;基于个人的宏观经济环境、行业政策趋势等基本面研究,运用定性定量模型,采取适当的行业配置策略以及上下游产业链的投资策略。
业绩比较基准	中债企业债信用债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 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	17,396,364.07	
2.本期利润	13,382,393.82	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0647	
4.期末基金资产净值	261,719,827.23	
5.期末基金份额净值	1.070	

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。

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	5.42%	0.37%	3.09%	0.09%	2.34%	0.28%

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变动的比较



注:按基金合同和招募说明书约定,本基金自基金合同生效日起90日内为建仓期,建仓期末时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十三部分(二)投资组合限制(六)投资组合行为与限制”的有关约定。

§4 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
胡青	本基金基金经理、嘉实增强收益定期债券基金基金经理、嘉实中证消费精选股票基金基金经理、嘉实中证健康产业基金基金经理	2014年3月28日	12年	曾任天安保险股份有限公司固定收益组合经理,国信基金管理有限责任公司投资经理,国信基金管理有限责任公司固定收益组合经理,嘉实基金管理有限公司基金经理,嘉实基金管理有限公司基金经理,嘉实基金管理有限公司基金经理

注:(1)基金经理离任日期是指基金管理人作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人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《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,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策略和业绩情况说明  
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩分析  
2015年2季度市场回顾:2季度债券市场走势出现大幅分化:1.短期利率出现全面大幅度下降,下降幅度100BP,2.长期利率进入大幅震荡行情,并伴有出现趋势性走势,3.收益率曲线出现明显的陡峭化下行,4.受到资金面紧张的影响,信用利差出现全面回落。

4.4.2 报告期内基金的投资表现  
截至本报告期末本基金份额净值为1.070元;本报告期基金份额净值增长率为5.42%,业绩比较基准收益率为3.09%。报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其他相关法律法规、《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》及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约定的规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4.3 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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易流程内控制公平交易执行细则,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。

4.4.3.2 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证券当日成交量的0.5%,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,629,380.00	0.64
	其中:股票	2,629,380.00	0.64
2	固定收益投资	385,247,046.70	94.47
	其中:债券	385,247,046.70	94.47
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,940,680.06	1.46
7	其他资产	13,989,682.56	3.43
	合计	407,106,799.32	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,629,380.00	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,629,380.00	1.00

5.2 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	000729	燕京啤酒	262,825	2,629,380.00	1.00

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,279,000.00	11.57
	其中:政策性金融债	30,279,000.00	11.57
4	企业债券	143,009,514.30	54.64
5	企业短期融资券	20,180,000.00	7.71
6	中期票据	182,674,000.00	69.80
7	可转债	9,104,532.40	3.48
8	其他	-	-
	合计	385,247,046.70	147.20

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150201	15国开10	300,000	30,279,000.00	11.57
2	124721	14财国债	200,000	21,196,000.00	8.10
3	1182246	11国债	200,000	20,890,000.00	7.98
4	1282535	12国债	200,000	20,234,000.00	7.73
5	1282527	12国债	200,000	20,234,000.00	7.73

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资组合公允价值变动情况

5.10 报告期末本基金投资组合公允价值变动情况

5.11 投资组合报告附注

5.12 投资组合报告附注

5.13 投资组合报告附注

5.14 投资组合报告附注

5.15 投资组合报告附注

5.16 投资组合报告附注

5.17 投资组合报告附注

5.18 投资组合报告附注

5.19 投资组合报告附注

5.20 投资组合报告附注

5.21 投资组合报告附注

5.22 投资组合报告附注

5.23 投资组合报告附注

5.24 投资组合报告附注

5.25 投资组合报告附注

5.26 投资组合报告附注

5.27 投资组合报告附注

5.28 投资组合报告附注

5.29 投资组合报告附注

5.30 投资组合报告附注

5.31 投资组合报告附注

5.32 投资组合报告附注

5.33 投资组合报告附注

5.34 投资组合报告附注

5.35 投资组合报告附注

5.36 投资组合报告附注

5.37 投资组合报告附注

5.38 投资组合报告附注

5.39 投资组合报告附注

5.40 投资组合报告附注

5.41 投资组合报告附注

5.42 投资组合报告附注

5.43 投资组合报告附注

5.44 投资组合报告附注

5.45 投资组合报告附注

5.46 投资组合报告附注

5.47 投资组合报告附注

5.48 投资组合报告附注

5.49 投资组合报告附注

5.50 投资组合报告附注

5.51 投资组合报告附注

5.52 投资组合报告附注

5.53 投资组合报告附注

5.54 投资组合报告附注