

万家稳健增利债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2015年6月30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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月17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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中的财务数据未经审计。
本报告自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家稳健增利债券
基金代码	519186
交易代码	519186
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2009年8月12日
报告期末基金份额总额	594,266,853.19份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的长期增值增值。
投资策略	在充分研究宏观市场环境以及证券市场主体的基础上,采取积极主动的投资管理策略,通过定性及定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行综合判断,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效特征,把握债券投资中的投资机会,在风险可控的前提下,实现基金收益的最大化。
业绩比较基准	中国债券指数
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其预期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合型基金、高净值市场基金。
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分属基金的资金简称	万家稳健增利债券C
下属分属基金的代码	519186
报告期末下属分属基金的前后总额	403,488,437.90份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	7,778,880.72
2.本期利润	13,077,610.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0340
4.期末基金资产净值	507,654,615.81
5.本期基金份额净值	1.2570

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

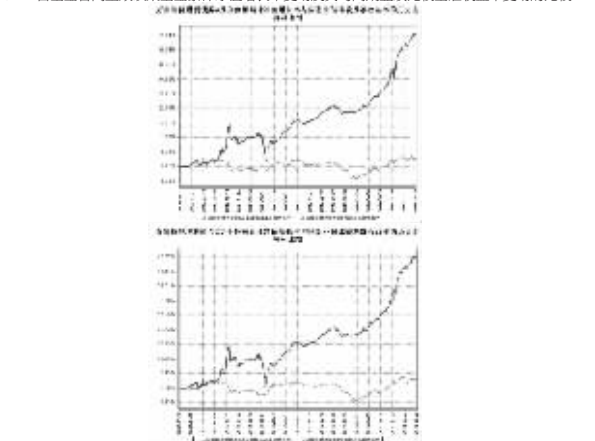
2、上表中本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

§3.1 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	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	2.78%	0.14%	1.34%	0.14%	1.44%

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	2.69%	0.14%	1.34%	0.14%	1.35%

§3.2 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:本基金于2009年8月12日成立,根据基金合同规定,基金合同生效后六个月内为建仓期,建仓期间结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
唐俊杰	基金基金经理、万家稳健增利债券基金经理	2012年3月17日至今	6年	硕士学历,曾任光大证券股份有限公司投资部,2011年9月加入万家基金管理有限公司。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。
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。
3、管理人报告期内本基金运作遵守法律法规、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,恪尽职守,勤勉尽责,安全高效的开展基金投资管理,在认真控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人的利益。

§4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《公平交易管理制度》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度,涵盖了授权、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。公司制订了明确的授权制度,并建立了统一的投资管理平台,确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度,对于交易所公开竞价交易,执行交易系统集中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行申购等集中竞价交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则公平的进行询价和成交交易。为保证公平交易,严格执行事前控制,通过对异常交易的实时监控和事后分析,及时发现异常交易,并及时采取纠正措施,确保公平交易制度的有效执行。

§4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。
4.1 报告期内无下列情况: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%。
4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.3 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.4 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.5 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.6 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.7 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.8 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.9 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.10 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.11 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.12 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.13 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.14 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.15 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.16 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.17 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.18 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.19 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

§4.20 公平交易制度的执行情况

截至报告期末,万家稳健增利债券A的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.78%,业绩比较基准收益率为1.34%,万家稳健增利债券C的份额净值为1.2570元,本报告期份额净值增长率为2.69%,业绩比较基准收益率为1.34%。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2015年一季度宏观经济企稳回升以及以货币政策下边际效应递减等不利因素推动,债券市场中长期端品种率先出现企稳回升的态势,短端品种则呈现震荡。本基金在一季度操作上,由于比较正确判断了经济企稳以及政策预期的变化,在收益上行和通胀上行预期下,加大了对利率债的配置力度,获得了良好的投资收益,并在二季度加仓了利率债的可转债,在季末下跌时加大了对高收益品种的持仓,有效规避了风险的同时获得了较好的回报。

基于以上的判断,在资产安全的前提下,三季度我们会密切关注经济数据的走势以及市场的动态,维持债券中性的组合久期,把仓位控制在中性偏高的水平,待收益率下降至偏低水平后再逐步减仓,同时密切关注权益市场下跌后反弹和持续加仓机会,把整体仓位控制在偏低水平,同时深入研究发现未来有上涨潜力的个股,适时进行择机加仓。

§4.6 报告期末基金资产净值及基金份额持有人数量

报告期末,本基金没有发生因基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元而终止的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

	其中:债券	874,921,398.90	92.37
	资产支持证券	--	--
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	23,800,571.39	2.51
7	其他资产	20,445,985.10	2.16
8	合计	947,164,306.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	5,783,009.16	0.78
C	制造业	-	-
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	5,278,800.24	0.71
J	金融业	15,446,341.32	2.07
K	房地产业	1,488,000.00	0.20
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	-	-

5.3 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	600016	民生银行	1,533,978	15,446,341.32	2.07
2	600993	岳阳纸业	467,881	5,783,009.16	0.78
3	600293	成都路桥	349,127	5,278,800.24	0.71
4	600067	冠城大通	150,000	1,488,000.00	0.20

5.4 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

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	59,220,011.00	7.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	235,352,000.00	31.55
4	其中:政策性金融债	235,352,000.00	31.55
5	企业债券	327,415,650.00	43.89
6	企业短期融资券	91,914,000.00	12.71
7	中期票据	224,365,000.00	30.08
8	可转债	6,144,137.30	0.82
9	合计	2,230,580.00	0.30
合计		874,921,308.90	117.29

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150209	15国开09	70,000	70,434,000.00	9.44
2	140203	14国开03	50,000	54,190,000.00	7.26
3	1318032	13平国债03	50,000	52,990,000.00	7.10
4	150206	15国开06	50,000	50,460,000.00	6.76
5	10145012	14央行票据01	400,000	41,168,000.00	5.52

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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股指期货投资情况说明

根据基金合同,本基金暂不开通股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

根据基金合同,本基金暂不开通国债期货。

5.11 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

根据基金合同,本基金暂不开通股指期货。

5.12 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

根据基金合同,本基金暂不开通股指期货。

5.13 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

根据基金合同,本基金暂不开通股指期货。

5.14 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

根据基金合同,本基金暂不开通股指期货。

5.15 报告期末本基金投资的股指期货