

天弘同利债券型证券投资基金 (LOF)

2017年第三季度报告

2017年9月30日
基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26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2017年10月23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请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告财务资料未经审计。
本报告自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	天弘同利债券
基金代码	420008
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2012年06月10日
报告期末基金份额总额	196,582,250.09份
投资目标	本基金在有效控制风险的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过宏观研判、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场环境等方面的分析判断,在严格的风险控制上,主动发现和捕捉投资机会,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币型基金,低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
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

主要财务指标	报告期 2017年7月1日-2017年9月30日
1.本期已实现收益	4,781,258.12
2.本期利润	5,482,281.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0100
4.期末基金份额净值	433,945,225.64
5.期末基金份额净值	1.007

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,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等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3,本基金合同于2013年9月17日起生效。

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	1.00%	0.06%	-0.15%	0.03%	1.15%	0.03%

3.2.2 自基金转型以来基金份额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,本基金合同于2013年9月17日生效,2016年9月19日本基金自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“天弘同利债券型证券投资基金(LOF)”。
2,本报告期内,本基金的各项投资比例均符合基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理年限	证券从业年限	说明
陈刚	本基金基金经理、固定收益部副经理	2013年9月	15年	男,工商管理硕士,曾任天津证券分公司资产管理部副经理,天弘同利债券型证券投资基金基金经理,现任天弘同利债券型证券投资基金基金经理。
胡洋	本基金基金经理	2017年6月	4年	女,经济学硕士,2013年11月加盟本公司,担任研究员、交易员。

注:1,上述任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。
2,上述任职日期为基金行业协(证)会从业(人员)资格管理办法的相关规定。
3,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合规情况的说明
本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在确保各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序,实行集中交易制度和公平交易分配制度,建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离,加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。
报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。
公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

3.1 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.2 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.3 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.4 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。
3.5 5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

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	30,031,000.00	6.92
其中:政策性金融债		30,031,000.00	6.92
4	企业债券	400,475,980.20	92.29
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	60,088,000.00	13.85
7	可转债	28,966.60	0.07
8	资产支持证券	--	--
9	其他	--	--
10	合计	480,881,976.80	113.12

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
金额单位:人民币元

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	122513	12国债13	396,000	39,993,700.00	9.21
2	178749	17国债增债02	300,000	30,000,000.00	6.92
3	148216	14年国债06	300,000	28,738,000.00	6.18
4	148202	14年国债03	300,000	25,238,000.00	5.72
5	148226	14国债逆回购	300,000	25,089,000.00	5.78

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交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内未发生基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
5.11.2 本基金本报告期末未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,234.97
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	10,430,238.32
5	应收申购款	57,068.51
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	10,492,578.80

5.11.4 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可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.11.7 投资组合报告附注
5.11.8 投资组合报告附注
5.11.9 投资组合报告附注
5.11.10 投资组合报告附注
5.11.11 投资组合报告附注
5.11.12 投资组合报告附注

5.11.13 投资组合报告附注
5.11.14 投资组合报告附注
5.11.15 投资组合报告附注
5.11.16 投资组合报告附注

5.11.17 投资组合报告附注
5.11.18 投资组合报告附注
5.11.19 投资组合报告附注
5.11.20 投资组合报告附注

5.11.21 投资组合报告附注
5.11.22 投资组合报告附注
5.11.23 投资组合报告附注
5.11.24 投资组合报告附注

5.11.25 投资组合报告附注
5.11.26 投资组合报告附注
5.11.27 投资组合报告附注
5.11.28 投资组合报告附注

5.11.29 投资组合报告附注
5.11.30 投资组合报告附注
5.11.31 投资组合报告附注
5.11.32 投资组合报告附注

5.11.33 投资组合报告附注
5.11.34 投资组合报告附注
5.11.35 投资组合报告附注
5.11.36 投资组合报告附注

5.11.37 投资组合报告附注
5.11.38 投资组合报告附注
5.11.39 投资组合报告附注
5.11.40 投资组合报告附注

5.11.41 投资组合报告附注
5.11.42 投资组合报告附注
5.11.43 投资组合报告附注
5.11.44 投资组合报告附注

5.11.45 投资组合报告附注
5.11.46 投资组合报告附注
5.11.47 投资组合报告附注
5.11.48 投资组合报告附注

5.11.49 投资组合报告附注
5.11.50 投资组合报告附注
5.11.51 投资组合报告附注
5.11.52 投资组合报告附注

5.11.53 投资组合报告附注
5.11.54 投资组合报告附注
5.11.55 投资组合报告附注
5.11.56 投资组合报告附注

5.11.57 投资组合报告附注
5.11.58 投资组合报告附注
5.11.59 投资组合报告附注
5.11.60 投资组合报告附注

5.11.61 投资组合报告附注
5.11.62 投资组合报告附注
5.11.63 投资组合报告附注
5.11.64 投资组合报告附注

5.11.65 投资组合报告附注
5.11.66 投资组合报告附注
5.11.67 投资组合报告附注
5.11.68 投资组合报告附注

5.11.69 投资组合报告附注
5.11.70 投资组合报告附注
5.11.71 投资组合报告附注
5.11.72 投资组合报告附注

5.11.73 投资组合报告附注
5.11.74 投资组合报告附注
5.11.75 投资组合报告附注
5.11.76 投资组合报告附注

5.11.77 投资组合报告附注
5.11.78 投资组合报告附注
5.11.79 投资组合报告附注
5.11.80 投资组合报告附注

5.11.81 投资组合报告附注
5.11.82 投资组合报告附注
5.11.83 投资组合报告附注
5.11.84 投资组合报告附注

5.11.85 投资组合报告附注
5.11.86 投资组合报告附注
5.11.87 投资组合报告附注
5.11.88 投资组合报告附注

5.11.89 投资组合报告附注
5.11.90 投资组合报告附注
5.11.91 投资组合报告附注
5.11.92 投资组合报告附注

5.11.93 投资组合报告附注
5.11.94 投资组合报告附注
5.11.95 投资组合报告附注
5.11.96 投资组合报告附注

5.11.97 投资组合报告附注
5.11.98 投资组合报告附注
5.11.99 投资组合报告附注
5.11.100 投资组合报告附注

5.11.101 投资组合报告附注
5.11.102 投资组合报告附注
5.11.103 投资组合报告附注
5.11.104 投资组合报告附注

5.11.105 投资组合报告附注
5.11.106 投资组合报告附注
5.11.107 投资组合报告附注
5.11.108 投资组合报告附注

5.11.3 其他资产构成
单位:人民币元

序号	名称	金额
----	----	----