

光大保德信晟利债券型证券投资基金招募说明书摘要(更新)

光大保德信晟利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2017年12月29日经中国证监会准予注册... 基金合同于2018年6月28日生效...

重要提示 一、基金管理人 光大保德信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)... 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则... 基金管理人不承担对证券投资业绩的保证责任...

一、基金管理人 (一)基金管理人概况 名称:光大保德信基金管理有限公司 成立时间:2004年4月22日 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]12号... 基金管理人:林昌 林昌先生,中国人民大学博士,中国国籍...

二、基金托管人 名称:中国光大银行股份有限公司 注册住所:北京市西城区太平桥大街25号... 基金托管人:李晓鹏 李晓鹏先生,中国人民大学博士,中国国籍...

三、基金份额发售机构 名称:光大证券股份有限公司 注册住所:上海市静安区威海路1508号... 基金管理人根据基金申购赎回业务需要...

四、基金的投资 (一)投资目标 本基金主要投资于具有良好流动性的债券,包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、央行票据、中期票据、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等...

(二)投资范围 本基金的投资范围包括:国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、央行票据、中期票据、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等... 法律法规及监管机构允许基金投资的其它金融工具...

五、基金的业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率。 六、基金的风险收益特征 本基金为债券型基金,预期风险和预期收益均低于股票型基金,高于货币市场基金...

七、基金的费用 基金费用的种类 1.基金管理人的管理费; 2.基金托管人的托管费; 3.销售服务费; 4.基金合同生效后与基金相关的信息披露费用; 5.基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、仲裁费和其他费用...

八、基金的投资组合报告 (一)报告期末基金资产组合情况 序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%) 1.权益投资 - - 其中:股票 - - 2.固定收益投资 816,727,950.00 96.24 其中:国债 50,139,000.00 7.35 地方政府债 30,130,000.00 3.60 企业债 30,495,000.00 4.43 公司债 250,880,000.00 36.64 可转债 475,510,950.00 69.64 其中:可转换债券 2,747,839.21 0.32 其中:分离交易可转债 848,673,992.29 100.00 3.其他资产 29,198,203.04 3.44 其中:应收款项 488,673,992.29 100.00

(二)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十五名债券投资明细 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 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46

九、基金的投资组合报告 (三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46

17. 上海好买基金销售有限公司 注册住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼 449室 办公地址:上海市浦东新区南汇新金桥国际大厦903-906室 法定代表人:杨文斌 客服电话:400-700-9665 联系人:张磊 电话:021-58877001 传真:021-68590619 网址:www.howbuy.com 18. 珠海盈米财富管理有限公司 注册住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔楼12楼B1201-1203 法定代表人:肖雯 客服电话:020-89629066 联系人:黄敏娥 电话:020-89629099 传真:020-89621011 网址:www.yingmi.com 19. 交通银行股份有限公司 办公地址:上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人:彭纯 客服电话:95559 联系人:王菁 电话:021-58781234 传真:021-58408483 网址:www.bankcomm.com 20. 中国建设银行股份有限公司 注册住所:北京市西城区金融大街25号 办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人:王洪章 客服电话:95533 联系人:王琳 电话:010-80626482 客服电话:4008-202-888 联系人:王颖 网址:www.ccb.com 21. 平安银行股份有限公司 注册住所:深圳市深南中路1099号平安银行大厦 法定代表人:孙建一 客服电话:95511-3 网址:www.pingan.com 22. 申万宏源证券有限公司 注册住所:上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 法定代表人:李梅 联系人:黄莹 电话:021-33388211 传真:021-33388224 23. 晋商银行股份有限公司 注册住所:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦 法定代表人:阎俊生 客服电话:95105588 联系人:董嘉文 电话:0351-6819926 传真:0351-6819926 网址:www.jshb.com 24. 东北证券股份有限公司 注册住所:长春市生态大街6666号 办公地址:吉林省长春市生态大街6666号 法定代表人:李福春 联系人:安广通 电话:0431-85096517 客服电话:95360 公司网址:www.nesc.cn 25. 国信证券股份有限公司 注册住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址:深圳市福田区红岭中路1012号国信证券大厦十层 法定代表人:何如 电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 联系人:齐晓燕 客服电话:95536 网址:www.guosen.com.cn 26. 光大证券股份有限公司 注册住所:上海市静安区新闸路1508号 办公地址:上海市静安区新闸路1508号 法定代表人:薛峰 电话:021-22169999 传真:021-22169134 客服电话:4008887888,10108998,95525 联系人:刘晨,李芳芳 网址:www.ebscn.com 27. 中泰证券股份有限公司(原齐鲁证券) 注册住所:济南市市中区经七路86号 法定代表人:李玮 客服电话:95538 公司网站: www.jiantoum.com 基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。 根据情况变化增加或减少其销售机构(网点),并另行公告。 (三)登记机构 名称:光大证券股份有限公司 注册住所:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心C幢,6层至10层 办公地址:上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心C幢(北区3号楼)6层至10层 法定代表人:林昌 电话: (021) 80262888 传真: (021) 80262483 联系人:陈蔚 经办律师:刘佳,张兰 (五)会计师事务所和经办注册会计师 名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 注册住所:中国上海浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 办公地址:中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼 法定代表人:李育 电话: (021) 23238888 传真: (021) 23238800 联系人:陈皓 经办会计师:薛莹,陈鹏 四、基金的名称:光大保德信晟利债券型证券投资基金 五、基金的投资目标: 本基金的投资目标 本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下,力争在获取预期收益的同时,实现基金资产的长期稳定增值。 六、基金的投资策略 本基金投资于具有良好流动性的债券(包括国债、金融债、地方政府债、企业债、可转债、中期票据、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、国债期货以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定)。 本基金采取买入持有策略,并可在必要时可转换转股所形成的股票。因持有该股票所派发的股息以及因转股分离交易可转债而产生的权证等。上述因持有有关的股票等证券资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金以后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。前述现金资产包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 七、基金的投资组合报告 (一)报告期末基金资产组合情况 序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%) 1.权益投资 - - 其中:股票 - - 2.固定收益投资 816,727,950.00 96.24 其中:国债 50,139,000.00 7.35 地方政府债 30,130,000.00 3.60 企业债 30,495,000.00 4.43 公司债 250,880,000.00 36.64 可转债 475,510,950.00 69.64 其中:可转换债券 2,747,839.21 0.32 其中:分离交易可转债 848,673,992.29 100.00 3.其他资产 29,198,203.04 3.44 其中:应收款项 488,673,992.29 100.00 八、基金的投资组合报告 (二)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十五名债券投资明细 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 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 九、基金的投资组合报告 (三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 十、基金的投资组合报告 (四)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 十一、基金的投资组合报告 (五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 十二、基金的投资组合报告 (六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 十三、基金的投资组合报告 (七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 十四、基金的投资组合报告 (八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 十五、基金的投资组合报告 (九)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 十六、基金的投资组合报告 (十)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 十七、基金的投资组合报告 (十一)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 十八、基金的投资组合报告 (十二)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 十九、基金的投资组合报告 (十三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 二十、基金的投资组合报告 (十四)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 二十一、基金的投资组合报告 (十五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 二十二、基金的投资组合报告 (十六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 二十三、基金的投资组合报告 (十七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 二十四、基金的投资组合报告 (十八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 二十五、基金的投资组合报告 (十九)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 二十六、基金的投资组合报告 (二十)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 二十七、基金的投资组合报告 (二十一)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 二十八、基金的投资组合报告 (二十二)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 二十九、基金的投资组合报告 (二十三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 三十、基金的投资组合报告 (二十四)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 三十一、基金的投资组合报告 (二十五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 三十二、基金的投资组合报告 (二十六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 三十三、基金的投资组合报告 (二十七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 三十四、基金的投资组合报告 (二十八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 三十五、基金的投资组合报告 (二十九)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.00 4.49 5 1282366 12国债附息03 300,000 30,561,000.00 4.46 三十六、基金的投资组合报告 (三十)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细 报告期末本基金持有的股票投资情况如下: 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 000001 平安银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 2 000012 招商银行 10,000,000 100,000,000.00 10.00 3 000033 美的集团 10,000,000 100,000,000.00 10.00 4 000059 五粮液 10,000,000 100,000,000.00 10.00 5 000100 长江电力 10,000,000 100,000,000.00 10.00 三十七、基金的投资组合报告 (三十一)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细 报告期末本基金持有的权证投资情况如下: 序号 权证代码 权证名称 数量 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 011802277 18中债国开180307 500,000 50,025,000.00 7.31 2 180209 18国债附息09 400,000 40,128,000.00 5.86 3 011605953 16国债附息03 315,000 31,540,950.00 4.61 4 10180422 18中债国开180404B 300,000 30,729,000.0