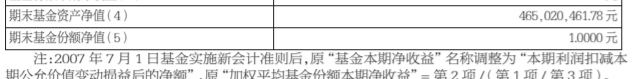


一、重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期为2007年7月1日起至2007年9月30日止，本报告财务资料未经审计。

二、基金产品概况
基金名称：泰达荷银货币市场基金
基金简称：荷银货币基金
基金代码：162206
基金运作方式：契约开放式
基金合同生效日：2006年11月10日
截至期末基金份额总额：465,020,461.78份
基金投资目标：在确保本金安全性和基金资产流动性的基础上，力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。
本基金投资策略：本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上，实施稳健的投资风格和谨慎的交易策略。以价值分析为基础，数量分析为支持，采用自上而下确定投资策略和自下而上券选择的程序，运用宏观分析、久期策略、收益率曲线策略和类属配置等积极投资策略，实现基金资产的保值增值。
本基金业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。
本基金风险收益特征：本基金属于证券投资基金中低风险、低风险的品种，其预期收益率和预期风险均低于股票、混合和债券型基金。

基金管理人名称：泰达荷银基金管理有限公司
基金托管人名称：交通银行股份有限公司
三、主要财务指标和基金净值表现
(一) 主要财务指标
本期利润总额(1) 4,111,487.00元
其中:本期公允价值变动损益后的净额(2) 4,111,487.00元
基金份额本期净收益(3) 0.0117元
期末基金份额净值(4) 465,020,461.78元
期末基金份额总额(5) 1,000.00份
注:2007年7月1日基金实施新会计准则后,原“基金份额净值”名称调整为“本期基金份额净值”,原“基金份额净值变动”调整为“基金份额净值变动”,原“加权平均基金份额本期净收益”第2项/第1项/第3项/第4项/第5项。
(二) 基金净值表现
1. 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较
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 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④
过去三个月 1.1599% 0.0122% 0.7633% 0.0013% 0.3926% 0.0109%

注:本基金收益分配按日结转,本基金收益分配方式为现金分红。
2. 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006年11月10日至2007年09月30日)



四、基金管理人报告
(一) 基金经理情况
邵冰先生,2002年毕业于北京大学经济学院金融学专业,获金融学硕士学位,同年加入泰达荷银基金管理有限公司,曾任任董事会秘书,2004年3月起担任研究部宏观固定收益研究员,2005年11月起担任货币市场基金基金经理,2006年12月起担任泰达荷银货币市场基金基金经理,2007年3月起兼任泰达荷银风险预算混合型基金基金经理。5年基金从业经验,具有基金从业资格。

(二) 遵规守纪情况
报告期内,本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。
(三) 投资策略与业绩表现说明
本基金在宏观经济持续向好、各经济主体为控制通胀预期执行的紧缩货币政策取得初步成效,尤其美联储于9月18日将联邦基金利率下调50个基点至4.75%,这是四年来的第一次。相关数据显示美联储已下调通胀预期,通胀,美联储更倾向于房地产市场出现更深的调整从而对影响消费和整体经济。在这样的宏观经济环境下,国内宏观经济也呈现小幅放缓的特征,市场预期下半年的经济增速将略低于上半年。从8月官方数据来看,8月全国规模以上工业增加值同比增长17.5%,较7月份的18.0%同比增长。从环比来看,8月环比增长率为22.7%,较7月份的34.1%大幅回落,8月份工业增加值同比增长率为20.1%,低于7月份的26.5%。上述指标表明前端的宏观调控效果明显,经济已经出现放缓的迹象。如果再考虑到7月份的信贷调控力度较大导致信贷增速回落,以及美国次贷危机导致的国内实体经济受到冲击进而影响到我国的外贸出口,我们预计四季度经济将继续放缓。

在经济增长放缓的同时,为了防范通货膨胀风险,避免利率率给实体经济造成过大波动,三季度央行继续调整加息,央行分别在7月、8月和9月三次提高存款准备金率,并于9月份再次提高存款准备金率0.5%。债券市场呈现先扬后抑的走势,7月和8月份央行两次加息后,配置利率债的机构减持使得市场出现一波回调。但随后特别国债面向市场发行,且9月份央行再次加息,债市反弹行情才得以终止。期间由于北京银行、建设银行、中国银行等大型商业银行,货币市场资金异常紧张,收益率曲线大幅飙升。而此前大受关注的特别国债面向市场直接发行,从3年期特别国债的发行情况看,发行情况明显好于市场预期。长债国债利率水平上升空间不大,市场收益率曲线平坦化趋势明显。
基于对货币市场走势的判断,我们在投资管理中继续坚持稳健的操作策略,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。在对基金申购赎回人结构分析,未来报告期内持有人申购赎回带来的基金流动性变化预期以及货币市场利率判断的基础上,采取的中长期策略,投资到期日分布的策略不仅规避了部分利率风险,而且有利于提高新增资金的投资收益,提升组合的流动性收益。我们在北京银行、建设银行、中国银行等大型商业银行发行,市场资金异常紧张的环境下,通过合理配置货币市场基金组合投资资产,流动性管理的前提下,提升组合的流动性收益。
展望2007年四季度,我们总体上仍将保持谨慎态度。从趋势上看,未来一段时间,投资、信贷有适度降温,通胀对债券市场的影响仍将持续一段时间,由于年内通胀压力依然较大,不排除央行再次提高存款准备金率的可能。当然美联储的加息可能在一定程度上将限制中国国内加息空间。我们认为央行加息的必要性将继续通过各种数量型调控的工具来得以政策调控,如法定准备金、央行发行、货币互换、正回购等,同时可能加大公开市场操作,避免通胀以何种方式进入国内。因此,在基金的投资管理,我们将紧密跟踪央行货币财政政策,及时把握市场资金面变化情况,继续严格执行基于MVS模型分析的决策机制,维持组合仓位期限,并保持投资组合的高流动性,严格控制利率风险和流动性风险。

五、投资组合报告
(一) 报告期末基金资产组合
资产组合 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
买入返售金融资产 228,489,487.75 48.81%
债券 89,000,598.04 19.01%
其中:买断式回购的买入返售债券 19,994,969.75 4.08%
银行存款和清算备付金 131,626,676.27 28.12%
其它资产 1,126,918.81 0.24%
合计 468,111,718.81 100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合
行业类别 市值(元) 占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业 1,707,410.81 0.04%
B 采矿业 435,499,977.1 9.87%
C 制造业 1,935,022,287.04 39.84%
D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 235,188,743.50 4.84%
E 建筑业 0.00 0.00%
F 交通运输、仓储业 389,212,084.04 8.01%
G 信息技术业 90,284,000.00 1.88%
H 批发和零售业 232,433,977.00 4.79%
I 房地产业 559,043,274.91 11.51%
J 金融业 296,988,643.32 6.11%
K 社会服务业 49,032,000.00 1.01%
L 传播与文化产业 81,725,000.00 1.68%
M 综合类 81,725,000.00 1.68%
合计 4,113,957,546.83 84.07%

(三) 报告期末按市值占基金总资产比例前五名的股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 市值(元) 占基金资产净值比例
1 600150 中国船舶 850,000 232,891,500.00 4.80%
2 600688 上海钢铁 4,817,235 196,880,394.65 4.05%
3 601318 中国平安 1,434,892 193,626,529.90 3.99%
4 000024 招商地产 2,449,000 189,600,000.00 3.90%
5 000012 南 莱 A 5,999,995 143,999,160.00 2.98%
6 601111 中国中铁 6,000,144 154,000,000.00 2.91%
7 601006 大秦铁路 5,500,000 140,085,000.00 2.88%
8 000858 五粮液 3,500,000 126,000,000.00 2.65%
9 600096 云天化 2,400,000 120,816,000.00 2.49%
10 600030 中信证券 1,200,000 116,052,000.00 2.43%

(四) 报告期末按品种分类的债券投资组合
品种 市值(元) 占基金资产净值比例
国债 149,582,389.50 3.08%
金融债 97,620,000.00 2.01%
央行票据 0.00 0.00%
企业债 1,842,448.00 0.04%
可转债 0.00 0.00%
合计 249,024,838.30 5.13%

(五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合
序号 债券名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合
序号 债券名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(十九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(二十九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(三十九) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十一) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十二) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十四) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十五) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%

(四十七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 市值(元) 占基金资产净值比例
1 07国债07 97,620,000.00 2.01%
2 07国债08 54,437,389.50 1.12%
3 07国债09 49,850,000.00 1.03%
4 20国债01 25,075,000.00 0.52%
5 21国债01 20,200,000.00 0.42%