长盛中信全债指数增强型债券投资基金 2008年半年度报告摘要

重要提示

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证长盛中信全债指数增强型债券投资基金（以下简称“本基金”）2008年半年度报告（以下简称“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。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2008年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告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。投资有风险，投资者在做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2008年1月1日至2008年6月30日，本报告期的财务资料未经审计。

第一章 基金简介

一、基金基本资料

（一）基金名称：长盛中信全债指数增强型债券投资基金

（二）基金简称：长盛债券基金

（三）基金交易代码：510080（前端收费模式）；511080（后端收费模式）

（四）基金运作方式：契约型开放式

（五）基金合同生效日：2003年10月25日

（六）报告期末基金份额总额：1,490,733,104.47份

（七）基金合同存续期：不定期

（八）基金份额上市的证券交易所：无

（九）上市日期：无

二、基金产品说明

（一）投资目标

本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产的当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。

（二）投资策略

本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。

（三）业绩比较基准

中信全债指数收益率×92%+中信综合指数收益率×8%。

（四）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

三、基金管理人

（一）名称：长盛基金管理有限公司

（二）信息披露负责人：叶金松

（三）联系电话：010-82255818

（四）传真：010-82255988

（五）电子邮箱：yejs@csfunds.com.cn

四、基金托管人

（一）名称：中国农业银行

（二）信息披露负责人：李芳菲

（三）联系电话：010-68424199

（四）传真：010-68424181

（五）电子邮箱：lifangfei@abchina.com

五、信息披露

（一）登载本报告正文的管理人互联网网址：http://www.csfunds.com.cn。

（二）基金半年度报告置备地点：本报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公地址，供公众查阅、复制。

第二章 主要财务指标和基金净值表现

所述基金业绩指标不包括基金份额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。

一、主要财务指标

序号	主要财务指标	
1	本期利润（元）	-120,928,578.90
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	24,486,322.51
3	加权平均份额本期利润（元/份）	-0.0851
4	期末可供分配利润（元）	16,891,845.78
5	期末基金资产净值（元）	1,689,248,818.05
6	期末基金份额净值（元/份）	1.1332
7	本期份额净值增长率	-6.68%

二、基金净值表现

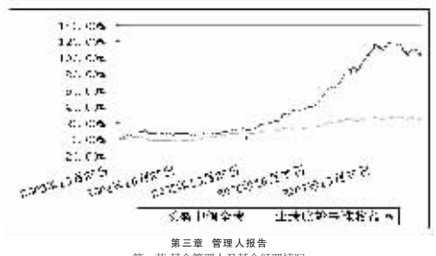
（一）本基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

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）
过去一个月	-2.38%	0.0040	-2.26%	0.0030	-0.12%	0.0010
过去三个月	-1.30%	0.0044	-2.22%	0.0028	0.92%	0.0016
过去六个月	-6.68%	0.0046	-2.49%	0.0026	-4.19%	0.0020
过去一年	9.57%	0.0046	0.73%	0.0022	8.84%	0.0024
过去三年	85.23%	0.0040	17.28%	0.0018	67.95%	0.0022
自基金合同生效日起至今	103.46%	0.0037	23.04%	0.0017	80.42%	0.0020

（三）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

长盛中信全债指数增强型债券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2003年10月25日至2008年6月30日）



第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理情况

一、基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币10000万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司，以下简称“国元证券”）占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省创新投资有限公司占注册资本的13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2008年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、八支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月，取得合格境内机构投资者资格，并于2008年2月，取得从事特定客户资产管理业务资格。

二、基金经理简介

王茜女士，1976年3月出生。武汉大学工商管理硕士。1996年7月至2002年6月，历任武汉市商业银行信贷管理部交易员、副经理、总经理助理。2002年7月至2002年8月，任职于中信证券固定收益部。2002年9月加入长盛基金管理有限公司，负责债券组合管理，曾担任全国社保基金债券委托组合经理助理，自2003年10月25起任长盛中信全债指数增强型债券投资基金（本基金）基金经理，自2005年12月12日起兼任长盛货币市场基金基金经理。

第二节 对报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，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利益的行为。

第三节 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

一、报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2008年上半年，高通胀和经济减速成为全球经济面临的共同问题。在巨大的市场风险和经济的不确定性下，有着确定升值背景的中国市场成为了热钱的避风港，然而国内股票市场未能演绎出流动性过剩下的下半场牛市行情，相反股债券市场却不惧通胀走出了阶段性行情。就债券市场而言，一季度，由于央行严格信贷管制导致的商业银行债券需求大幅增长，而人民币持续升值及中美利差不断扩大使国内债券市场对境外投资人具有了绝对投资价值，再加上普通投资人对风险偏好的迅速使得债券市场形成了一波资金推动下的小幅上扬行情；二季度，受央行连续上调准备金比率和投资人升息预期的影响，债券市场未能延续1季度的强势，表现疲弱并小幅回落；总体来看，上半年债券市场波澜不惊，收益率曲线呈现扁平化特征，但相比较深幅下跌的股票市场，债券市场格外引人关注。截止至6月末，上证国债指数较年初上涨2.29%，中信银行间债券总指数上涨1.80%。而同期，由于投资人对经济减速、高通胀以及企业盈利水平下降的深度担忧，再加上大小非减持的扩容压力，股票市场连续深幅下挫，市场空前低迷，到处充斥着恐慌情绪。截至6月末，上证指数较年初下跌48.00%；受股票市场影响，转债市场也大幅下跌，到6月末，天相转债指数较年初下跌34.21%。

本基金管理人在上半年的投资管理中，尽管适时增加了债券资产的配置比重，但由于我们对股票市场预期相对乐观，对其趋势性转变认识不够深刻，在投资策略及组合调整上不够及时、果断，造成当期尤其是一季度组合中股票资产配置比重过高，给基金投资人带来了一定的资产损失，投资业绩不理想。

二、本基金业绩表现

截至6月末，长盛债券型基金份额净值1.1332元，当期净值增长率为-6.68%，低于同期比较基准4.19个百分点。

第四节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

展望2008年下半年，“货币政策、通胀、油价、美元币值”将成为市场关注的重点，而全球经济一体化过程中各国政府间所表现出的在等待中博弈的态度无疑将增大全球经济形势的不确定性。我们认为国内经济增长的下行趋势已基本确立，未来经济能否实现“软着陆”、通胀能否得到有效控制最终将取决于政府调控政策取向及资源价格理顺进度。从通胀情况看，我们认为年内顶点已见，未来将有所回落，但回落的过程将是缓慢的，甚至可能出现短期反弹。而从利率角度看，尽管提高基准利率是抑制通胀预期的有效方式，但从现有的政策空间看，年内可升息幅度有限。因此，就债券市场而言，基本面因素正朝好的方向发展，但由于现阶段债券的实际收益率水平仍为负，绝对价值不明显，再加上下半年资金面存在一定的变数，流动性压力增大，债券市场下半年的总体机会不大，上涨空间取决于市场能否充分调整，在组合构建上我们仍将重点关注中短期浮息债券、高信用评级债券及创新工具，以获得稳定的利息收入和规避风险为主。就权益类资产而言，股票市场在经历了上半年的快速深幅下跌后，尽管存在较大的反弹动能，但由于投资人普遍预期企业未来盈利水平下降、市场估值中枢可能进一步下移，其总体方向仍会是震荡下行的。

基于以上判断，下半年本基金将在风险控制前提下，强调资产的安全性并适度保持组合弹性。首先保持对固定收益类债券资产的战略性配置以获得稳定的利息收入，同时根据市场变化择机增持债券资产并调整战术性债券资产的久期；其次伺机参与新股一级市场认购，择机参与优质股票再融资；最后注重安全边际，目下而上精选个股，慎重参与股票市场的阶段性机会。

第五节 公平交易制度执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。目前，本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。本报告期内，本基金未发生异常交易情况。

第四章 托管人报告

在托管长盛中信全债指数增强型债券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》的约定，对长盛中信全债指数增强型债券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司2008年1月1日至2008年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在长盛中信全债指数增强型债券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长盛中信全债指数增强型债券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

2008年8月28日

第五章 财务会计报告

第一节 基金会计报表（未经审计）

一、资产负债表

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

资产负债表

单位：人民币元

项 目	2008年6月30日	2007年12月31日
资 产		
银行存款	175,832,122.82	227,899,508.50
结算备付金	353,868.15	973,012.48
存出保证金	710,000.00	710,000.00
交易性金融资产	1,594,533,994.05	1,157,910,587.89
其中：股票投资	178,080,884.05	214,645,776.65
债券投资	1,416,453,110.00	943,264,811.24
衍生金融资产	4,045,475.47	2,147,968.51
应收证券清算款	139,000,000.00	0.00
应收利息	18,540,744.08	10,556,610.90
应收申购款	397,682.49	7,948,191.92
资产总计	1,933,413,887.06	1,408,145,880.20
负债和所有者权益		
负 债		
卖出回购金融资产款	117,599,703.60	0.00
应付证券清算款	2,699,886.53	0.00
应付赎回款	1,832,498.78	3,456,729.43
应付管理人报酬	1,166,081.51	853,526.69
应付托管费	310,955.08	227,607.13
应付交易费用	584,870.51	112,173.08
应交税费	228,456.73	228,456.73
应付利息	53,408.65	0.00
应付利润	119,258,647.90	0.00
其他负债	430,559.72	323,052.92
负债合计	244,165,069.01	5,201,545.98
所有者权益		
实收基金	1,490,733,104.47	1,079,131,597.87
未分配利润	198,515,713.58	323,812,736.35
所有者权益合计	1,689,248,818.05	1,402,944,334.22
负债和所有者权益总计	1,933,413,887.06	1,408,145,880.20

注：2008年6月30日每份额基金资产净值：1.1332元，2007年末每份额基金资产净值：1.3001元。后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、利润表

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

利润表

单位：人民币元

项 目	2008年上半年	2007年上半年
收入		
利息收入	24,966,034.69	4,863,111.93
其中：存款利息收入	1,250,594.93	660,004.29
债券利息收入	23,715,439.76	4,200,950.95
买入返售金融资产收入	0.00	2,156.69
投资收益	13,007,279.45	46,534,975.90
其中：股票投资收益	14,469,765.59	41,325,262.95
债券投资收益	-7,220,722.58	3,099,787.86
衍生工具收益	4,784,386.31	1,785,660.85
股利收益	973,850.13	324,264.24
公允价值变动收益	-145,414,901.41	36,361,094.56
其他收入	565,939.23	199,616.44
收入合计	-106,875,648.04	87,958,798.83
费用		0.00
管理人报酬	6,616,558.92	1,844,783.21
托管费	1,764,415.67	491,942.21
交易费用	2,302,224.75	590,024.97
利息支出	3,196,634.86	1,462,578.62
其中：卖出回购金融资产支出	3,196,634.86	1,462,578.62
其他费用	173,096.66	170,926.62
费用合计	14,052,930.86	4,560,255.63
利润总额	-120,928,578.90	83,398,543.20

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

三、所有者权益（基金净值）变动表

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

所有者权益（基金净值）变动表

单位：人民币元

项 目	2008年上半年		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益（基金净值）	1,079,131,597.87	323,812,736.35	1,402,944,334.22
本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	-120,928,578.90	-120,928,578.90
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	411,601,506.60	114,890,204.03	526,491,710.63
其中：基金申购款	1,048,405,295.82	268,909,899.48	1,317,315,195.30
基金赎回款	-636,803,789.22	-154,019,695.45	-790,823,484.67
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	-119,258,647.90	-119,258,647.90
期末所有者权益（基金净值）	1,490,733,104.47	198,515,713.58	1,689,248,818.05
项 目	2007年上半年		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益（基金净值）	126,222,587.34	17,294,911.70	143,517,499.04
本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	83,398,543.20	83,398,543.20
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	552,438,247.54	92,036,232.53	644,474,480.07
其中：基金申购款	802,729,933.18	142,646,837.62	945,376,770.80
基金赎回款	-250,291,685.64	-50,610,605.09	-300,902,290.73
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	-21,364,574.11	-21,364,574.11
以前年度损益调整产生的基金净值变动数	0.00	-796,805.60	-796,805.60
期末所有者权益（基金净值）	678,660,834.88	170,568,307.72	849,229,142.60

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

第六章 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产项目	金额（人民币元）	占基金资产总值比例
股票投资市值	178,080,884.05	9.21%
债券投资市值	1,416,453,110.00	73.26%
权证投资市值	4,045,475.47	0.21%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	176,185,990.97	9.11%
其他资产	158,648,426.57	8.21%
合 计	1,933,413,887.06	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

分 类	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
A农,林,牧,渔业	326,815.28	0.02%
B采掘业	15,330,420.60	0.91%
C制造业	113,529,289.18	6.72%
C0食品,饮料	21,606,000.00	1.28%
C1纺织,服装,皮毛	235,096.40	0.01%
C2木材,家具	971,774.61	0.06%
C3造纸,印刷	4,415,360.22	0.26%
C4石油,化学,塑胶,塑料	15,045,898.38	0.89%
C5电子	16,660,325.50	0.99%
C6金属,非金属	5,665,991.31	0.34%
C7机械,设备,仪表	15,738,026.09	0.93%
C8医药,生物制品	32,999,985.77	1.95%
C99其他制造业	190,830.90	0.01%
D电力,煤气及水的生产和供应业	2,572,000.00	0.15%
E建筑业	13,014,828.04	0.77%
F交通运输,仓储业	8,794,000.00	0.52%
G信息技术业	9,669,247.78	0.57%
H批发和零售贸易	11,728,594.10	0.69%
I金融,保险业	2,463,000.00	0.15%
J房地产业	0.00	0.00%
K社会服务业	169,267.32	0.01%
L传播与文化产业	483,421.75	0.03%
M综合类	0.00	0.00%
合 计	178,080,884.05	10.54%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例
1	002025	航天电器	1,479,846	12,356,714.10	0.73%
2	601088	中国神华	320,000	12,022,400.00	0.71%
3	000729	燕京啤酒	700,000	11,760,000.00	0.70%
4	600737	中粮屯河	600,000	9,846,000.00	0.58%
5	000538	云南白药	330,000	8,939,700.00	0.53%
6	601186	中国铁建	780,964	7,309,823.04	0.43%
7	600479	千金药业	396,000	7,179,480.00	0.43%
8	601006	大秦铁路	500,000	6,805,000.00	0.40%
9	600351	亚宝药业	530,442	6,566,871.96	0.39%
10	002215	诺普信	330,234	6,419,748.96	0.38%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司互联网网址：http://www.csfunds.com.cn的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额（人民币元）	占期初基金资产净值的比例
1	002069	獐子岛	21,246,583.14	1.51%
2	601318	中国平安	21,137,000.00	1.51%
3	600737	中粮屯河	19,536,285.40	1.39%
4	002025	航天电器	15,283,934.38	1.09%
5	600309	烟台万华	15,082,941.26	1.08%
6	000729	燕京啤酒	14,353,582.57	1.02%
7	000527	美的电器	12,727,563.99	0.91%
8	002080	中材科技	12,222,775.49	0.87%
9	002215	诺普信	12,043,336.37	0.86%
10	600028	中国石化	11,999,500.00	0.86%
11	600820	隧道股份	11,910,712.59	0.85%
12	600026	中海发展	11,159,599.50	0.80%
13	000538	云南白药	10,153,689.36	0.72%
14	000898	鞍钢股份	10,141,255.09	0.72%
15	601186	中国铁建	9,877,273.12	0.70%
16	601898	中煤能源	9,601,346.70	0.68%
17	601919	中国远洋	9,537,915.16	0.68%
18	000024	招商地产	9,305,765.00	0.66%
19	600795	国电电力	9,243,494.37	0.66%
20	600406	国电南瑞	8,698,115.00	0.62%

（二）报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前20名股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额（人民币元）	占期初基金资产净值的比例
1	601939	建设银行	21,714,284.80	1.55%
2	601857	中国石油	19,420,076.23	1.38%
3	601318	中国平安	17,066,941.10	1.22%
4	600795	国电电力	16,854,900.41	1.20%
5	002069	獐子岛	13,154,418.45	0.94%
6	601898	中煤能源	11,710,969.00	0.83%
7	000898	鞍钢股份	10,062,202.00	0.72%
8	601866	中海集运	8,276,965.76	0.59%
9	601601	中国太保	8,267,798.20	0.59%
10	601919	中国远洋	8,063,216.81	0.57%
11	600026	中海发展	7,039,277.60	0.50%
12	600309	烟台万华	6,688,917.00	0.48%
13	000024	招商地产	6,223,479.18	0.44%
14	600030	中信证券	6,167,000.00	0.44%
15	601390	中国中铁	6,139,644.80	0.44%
16	002080	中材科技	6,057,449.55	0.43%
17	600028	中国石化	6,043,792.50	0.43%
18	601088	中国神华	5,822,728.00	0.42%
19	601958	金钼股份	5,676,180.00	0.40%
20	600409	三友化工	5,581,561.00	0.40%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项 目	金额（人民币元）
买入股票成本总额	414,483,229.18
卖出股票收入总额	332,586,492.60

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
国 债	12,528,808.80	0.74%
金融债	1,354,365,000.00	80.18%
央行票据	0.00	0.00%
企业债	28,456,054.90	1.68%
可转债	21,113,246.30	1.25%
合 计	1,416,453,110.00	83.85%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细

序号	债券名称	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
1	07国开24	201,560,000.00	11.93%
2	05农发06	118,656,000.00	7.02%
3	06国开13	101,050,000.00	5.98%
4	07农发21	100,970,000.00	5.98%
5	07国开26	100,750,000.00	5.96%

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证明细

（一）报告期末持有权证明细：

序号	权证名称	代码	数量（份）	市值（人民币元）	市值占基金净资产比例	获得方式
1	国电CWB1	580022	1,060,691	4,045,475.47	0.24%	被动持有
合计				4,045,475.47		

（二）报告期内获得权证明细

获取方式	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额 （人民币元）
被动持有	031006	中兴ZXC1	462,040	5,589,494.14
	580019	石化CWB1	687,709	1,605,198.29
	580020	上港CWB1	722,568	1,075,667.34
	580021	青啤CWB1	316,330	1,172,520.27
	580022	国电CWB1	1,060,691	2,489,200.15
	580023	康美CWB1	489,140	813,756.79

九、投资组合报告附注

（一）本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（二）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

（三）报告期末基金的其他资产构成

其他资产项目	金额（人民币元）
存出保证金	710,000.00
应收利息	18,540,744.08
应收申购款	397,682.49
应收证券清算款	139,000,000.00
合 计	158,648,426.57

（四）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
110598	大荒转债	8,690,515.20	0.51%
110078	澄星转债	7,640,437.50	0.45%
125960	锡业转债	3,442,903.20	0.20%
110227	赤化转债	215,160.00	0.01%

（五）本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期初基金管理人所持有的本基金分额	29,937,118.12
本报告期间基金管理人所持有的本基金分额增加	0.00
本报告期间基金管理人所持有的本基金分额减少	0.00
本报告期末基金管理人所持有的本基金分额	29,937,118.12

第七章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数（户）	27,801
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	53,621.56

（下转C75版）