

## 投资组合报告

### 1.1 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	固定收益投资	5,529,986,585.01	83.22
	其中：债券	5,529,986,585.01	83.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	640,030,973.05	9.63
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	411,343,443.85	6.19
4	其他资产	63,294,641.33	0.95
5	合计	6,644,655,643.24	100.00

### 1.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.48	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资 产净值比例（%）	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：报告期内货币市场基金债券正回购的资金余额未有超过基金资产净值 20%的情况。

### 1.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 1.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：报告期内组合平均剩余期限未违规超过 120 天。

#### 1.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	27.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	7.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	45.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.11	-

#### 1.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余存续期	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

#### 1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	810,084,423.54	12.20
	其中：政策性金融债	810,084,423.54	12.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,268,860.98	2.56
6	中期票据	180,886,003.09	2.72
7	同业存单	4,368,747,297.40	65.79
8	其他	-	-
9	合计	5,529,986,585.01	83.27
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 1.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	160215	16 国开 15	3,000,000	299,967,418.75	4.52
2	111994445	19 徽商银行	2,000,000	198,620,287.70	2.99

		CD030			
3	111908120	19 中信银行 CD120	2,000,000	197,309,445.97	2.97
4	111909022	19 浦发银行 CD022	1,500,000	148,588,084.51	2.24
5	180216	18 国开 16	1,200,000	119,960,342.51	1.81
6	140224	14 国开 24	1,000,000	100,500,558.64	1.51
7	180209	18 国开 09	1,000,000	100,005,480.69	1.51
8	111814203	18 江苏银行 CD203	1,000,000	99,863,171.10	1.50
9	111812157	18 北京银行 CD157	1,000,000	99,858,499.55	1.50
10	111809225	18 浦发银行 CD225	1,000,000	99,814,910.57	1.50

### 1.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0929%
报告期内偏离度的最低值	-0.0016%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0349%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：报告期内负偏离度的绝对值未有达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：报告期内正偏离度的绝对值未有达到 0.5%的情况。

### 1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：报告期末，本基金未持有资产支持证券。

### 1.9 投资组合报告附注

1.9.1 本基金估值采用摊余成本法估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00 元

1.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

无。

### 1.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	25,204,261.24
4	应收申购款	38,090,380.09
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	63,294,641.33

### 1.9.4 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。