

大成基金宝坻大申购申赎货币市场基金更新招募说明书摘要

(2015年第1期)

基金管理人：大成基金管理有限公司 基金托管人：中国农业银行股份有限公司 二〇一五年五月

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
本基金合同规定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”。本报告期末，本基金投资组合平均剩余期限符合合同约定。

4.报告期内投资组合平均剩余期限分档比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	48.00	28.00
1	其中：剩余存续期限不超过30天的浮动利率资产	1.14	0.00
2	30天以上-90天	9.69	6.00
2	其中：剩余存续期限超过30天但不超过90天的浮动利率资产	0.75	0.00
3	90天以上-180天	21.61	0.00
3	其中：剩余存续期限超过90天但不超过180天的浮动利率资产	0.00	0.00
4	180天以上-395天	21.61	0.00
4	其中：剩余存续期限超过180天但不超过395天的浮动利率资产	0.00	0.00
合计		105.26	28.00

5.报告期内投资组合品种分类下的债券投资情况

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	400,643,688.11	15.18
3	其中：政策性金融债	400,643,688.11	15.18
4	企业债券	-	0.00
5	企业中期票据	1,160,535,481.25	43.98
6	中期票据	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	1,561,179,169.36	59.16
	报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的浮动利率资产	80,468,528.87	3.05

5. 报告期内投资组合按摊余成本法计算的资产净值与公允价值计量的前十名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

6. “影子定价”与摊余成本法计算的基金资产净值的偏差

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%—0.5%间的次数	32
报告期内偏离度的最高值	0.4728%
报告期内偏离度的最低值	-0.0833%
报告期内偏离度绝对值超过0.5%的次数	0

报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

7. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

8. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

9. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

10. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

11. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

12. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

13. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

14. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	
2	011420005	14附息国债05	800,000	800,017,457.81	3.03	
3	04145035	14债信CP01	700,000	704,831,409.99	2.67	
4	041450385	14债信CP02	700,000	704,063,676.76	2.65	
5	011481003	14债信07	700,000	699,976,678.76	2.65	
6	130011	13国债17	600,000	605,028,015.15	2.28	
7	140204	14债信F04	600,000	600,046,788.92	2.27	
8	041450353	14债信CP03	500,000	504,204,022.22	1.91	
9	041450409	14债信CP03	500,000	502,077,689.69	1.90	
10	011481005	14债信08	500,000	500,026,280.94	1.89	

15. 报告期内投资组合中公允价值占基金资产净值比例大于10%的前十名资产支持证券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比例(%)
1	140213	14债信13	800,000	800,021,189.34	3.03	