

(上接B39版)

**九、基金的业绩比较基准**  
本基金的业绩比较基准为税后一个月定期存款利率(即1—利息税率)×6个月银行定期存款利率。

如果某只货币市场基金有其他类型投资者(如机构投资者)的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金持有人利益的原则,在报中国证监会备案后,将该类投资者的业绩比较基准调整为适合该类投资者的业绩比较基准。

如果某只货币市场基金有其他类型投资者(如机构投资者)的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金持有人利益的原则,在报中国证监会备案后,将该类投资者的业绩比较基准调整为适合该类投资者的业绩比较基准。

**十、基金的估值政策和方法**  
本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,其风险相对较低的基本产品。一般情况下,其风险与预期收益均低于一般股票型基金。

**十一、基金的费用组合报告**  
基金管理人和基金托管人根据本报告所披露的数据不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性负责。

基金管理人和基金托管人承诺不存在损害基金份额持有人利益的行为,并承诺在本报告期内不从事违反基金合同和法律规定的投资活动。

基金管理人和基金托管人承诺在本报告期内不进行任何损害基金份额持有人利益的关联交易。

基金管理人和基金托管人承诺在本报告期内不从事任何可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

本报告期为2013年10月01日起至2013年10月31日止。

本报告期未发生重大关联交易。

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	1,660,407,444.92	20.38
其中：债券	1,660,407,444.92	20.38	
资产支持证券	-	-	
2	买入返售金融资产	880,001,200.00	10.80
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	5,482,116,789.96	67.30
4	其他资产	123,506,164.64	1.52
5	合计	8,146,031,599.53	100.00

2、报告期利润明细情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券投资收益	3.37
其中：买入式回购投资	0.00	
2	报告期末债券投资收益	3.98
其中：买入式回购投资	-	

注:报告期利润总额占基金资产净值的比例为报告期间每个交易日基金资产净值占基金资产净值的平均值。

基金利润总额指基金的净利润加上公允价值变动损益的20%的说明。

本报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%。

3、报告期利润分配情况

(1) 报告期内每十份基金份额利润情况:

序号	项目	天数
1	报告前一日投资组合平均剩余期限	74
其中：买入式回购投资	-	
2	报告前一日投资组合平均剩余期限最高值	94
3	报告前一日投资组合平均剩余期限最低值	44

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过18.0天的情况。

(2) 报告期内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的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.05	3.98
其中：剩余期限小于397天的浮动利差债券	-	-	
2	30天(含)-60天	43.81	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	
3	60天(含)-90天	22.97	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	

注:上述“浮动利差”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

6、“分子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

报告期内债券投资组合的浮动利差债券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	120228	12国开28	3,600,000	359,991,394.78	4.78
2	120314	13国债14	3,100,000	309,568,699.08	4.11
3	131020	13国债10	1,700,000	169,966,701.96	2.26
4	041352001	11南京水行CP001	1,200,000	120,620,113.74	1.60
5	110206	11国债10	1,100,000	110,137,281.69	1.46
6	041254053	12华能CP002	1,000,000	100,104,586.80	1.33
7	041272003	12普光CP001	800,000	80,019,767.75	1.06
8	041359000	13环能CP001	500,000	50,002,632.97	0.66
9	041251035	12海闻CP002	500,000	50,000,564.65	0.66
10	041259043	12江浦CP001	500,000	50,000,145.10	0.66

注:上述“浮动利差”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

报告期内债券投资组合的浮动利差债券的前十名债券投资明细

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最高值	299,999,650.00	3.98
2	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最低值	-	-

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%的说明。

本报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%。

4、报告期利润分配情况

(1) 报告期内每十份基金份额利润情况:

序号	项目	天数
1	报告前一日投资组合平均剩余期限	74
其中：买入式回购投资	-	
2	报告前一日投资组合平均剩余期限最高值	94
3	报告前一日投资组合平均剩余期限最低值	44

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过18.0天的情况。

(2) 报告期内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的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.05	3.98
其中：剩余期限小于397天的浮动利差债券	-	-	
2	30天(含)-60天	43.81	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	
3	60天(含)-90天	22.97	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	

注:上述“浮动利差”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

6、“分子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

报告期内债券投资组合的浮动利差债券的前十名债券投资明细

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最高值	299,999,650.00	3.98
2	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最低值	-	-

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%的说明。

本报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%。

5、报告期利润分配情况

(1) 报告期内每十份基金份额利润情况:

序号	项目	天数
1	报告前一日投资组合平均剩余期限	74
其中：买入式回购投资	-	
2	报告前一日投资组合平均剩余期限最高值	94
3	报告前一日投资组合平均剩余期限最低值	44

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过18.0天的情况。

(2) 报告期内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的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.05	3.98
其中：剩余期限小于397天的浮动利差债券	-	-	
2	30天(含)-60天	43.81	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	
3	60天(含)-90天	22.97	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	

注:上述“浮动利差”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

6、“分子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

报告期内债券投资组合的浮动利差债券的前十名债券投资明细

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最高值	299,999,650.00	3.98
2	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最低值	-	-

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%的说明。

本报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%。

7、报告期利润分配情况

(1) 报告期内每十份基金份额利润情况:

序号	项目	天数
1	报告前一日投资组合平均剩余期限	74
其中：买入式回购投资	-	
2	报告前一日投资组合平均剩余期限最高值	94
3	报告前一日投资组合平均剩余期限最低值	44

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过18.0天的情况。

(2) 报告期内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的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.05	3.98
其中：剩余期限小于397天的浮动利差债券	-	-	
2	30天(含)-60天	43.81	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	
3	60天(含)-90天	22.97	-
其中：剩余期限大于397天的浮动利差债券	-	-	

注:上述“浮动利差”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

6、“分子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏差

报告期内债券投资组合的浮动利差债券的前十名债券投资明细

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最高值	299,999,650.00	3.98
2	报告前一日债券投资组合平均剩余期限最低值	-	-

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%的说明。

本报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过基金资产净值的20%。

8、报告期利润分配情况

(1) 报告期内每十份基金份额利润情况:

序号	项目	天数
1	报告前一日投资组合平均剩余期限	74
其中：买入式回购投资	-	
2	报告前一日投资组合平均剩余期限最高值	94
3	报告前一日投资组合平均剩余期限最低值	44

注:报告期内地质勘探业和货币借贷业的净利润未超过18.0天的情况。

(2) 报告期内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的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1			