

(上接A18版)

| 序号 | 债券品种                                | 摊余成本              | 占基金资产净值比例(%) | 费用计算      |
|----|-------------------------------------|-------------------|--------------|-----------|
| 1  | 国家债券                                | 539,997,883.94    | 1.15         | 1,000,000 |
| 2  | 央行票据                                | -                 | -            | 1,200,000 |
| 3  | 金融债                                 | 7,743,390,995.41  | 16.47        | 0.8%      |
| 4  | 企业债券                                | 7,743,290,995.41  | 16.47        | 6,000     |
| 5  | 企业短期融资券                             | 213,117,398.24    | 0.45         | 1,194,000 |
| 6  | 中期票据                                | 4,340,150,067.31  | 9.23         | 0.09%     |
| 7  | 其他                                  | -                 | -            | 1,194,000 |
| 8  | 合计                                  | 12,866,556,344.90 | 27.30        | 0.00      |
| 9  | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券                  | 6,148,268,141.33  | 13.07        | 1,300     |
| 10 | （五）报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 918.46            | 918.46       | 918.46    |

(五)报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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             | 占基金资产净值比例(%) | 费用计算      |
|----|-----------|----------|------------|------------------|--------------|-----------|
| 1  | 110221    | 11国债21   | 21,300,000 | 2,094,496,928.67 | 4.45         | 1,000,000 |
| 2  | 130214    | 13国债14   | 16,000,000 | 1,598,128,117.79 | 3.40         | 1,200,000 |
| 3  | 130215    | 13国债15   | 10,200,000 | 1,003,978,024.35 | 2.14         | 0.8%      |
| 4  | 090205    | 09国债5    | 8,600,000  | 853,985,096.18   | 1.82         | 6,000     |
| 5  | 110212    | 11国债12   | 6,000,000  | 591,725,964.54   | 1.26         | 1,194,000 |
| 6  | 019219    | 12国开19   | 5,400,000  | 539,997,883.94   | 1.15         | 0.09%     |
| 7  | 110402    | 11国债02   | 4,500,000  | 443,583,713.13   | 0.94         | 1,194,000 |
| 8  | 130212    | 13国债12   | 4,200,000  | 412,890,440.68   | 0.88         | 0.00      |
| 9  | 100236    | 10国债36   | 3,900,000  | 386,574,991.99   | 0.82         | 1,300     |
| 10 | 041273004 | 12国开P001 | 3,500,000  | 349,956,518.97   | 0.74         | 1,194,000 |

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 项目                        | 偏债情况  | 费用计算      |
|----|---------------------------|-------|-----------|
| 1  | 报告期内偏债度的绝对值在0.5%含-0.5%的次数 | 0次    | 1,000,000 |
| 2  | 报告期内偏债度的最高值               | 0.2%  | 1,200,000 |
| 3  | 报告期末偏债度的最低值               | 0.07% | 6,000     |
| 4  | 报告期内工作日偏债度的绝对值的简单平均值      | 0.12% | 1,194,000 |

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总份额(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总份额(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金总资产(B)    | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金总资产(B)    | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(九)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(十)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(十一)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及金融衍生品投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(十二)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(十三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(十四)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及金融衍生品投资明细

| 序号 | 项目              | 费用计算       |
|----|-----------------|------------|
| 1  | 报告期初基金日均份额净值(B) | 10,000,000 |
| 2  | 报告期末基金日均份额净值(B) | 1,200,000  |
| 3  | 报告期初基金总资产(B)    | 12,000,000 |
| 4  | 报告期末基金总资产(B)    | 0.5%       |
| 5  | 报告期初基金负债(B)     | 6,000      |
| 6  | 报告期末基金负债(B)     | 1,194,000  |
| 7  | 报告期初基金净资产(B)    | 6,000      |
| 8  | 报告期末基金净资产(B)    | 1,194,000  |

(十五)报告期末按公允价值占基金资产净值