

(上接第2版)

(四) 报告期末未按债券品种分类的证券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	514,084,420.40	9.77
4	公司债券	514,084,420.40	9.77
5	企业债券	-	-
6	短期融资券	1,398,893,017.29	26.59
7	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	融资券	1,912,977,437.69	36.37
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	246,156,215.22	4.68

(五) 报告期末按债券品种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(%)
1	011409001	14国债(8期)	1,500,000	150,000,109.21	2.85
2	011404004	14国债(9期)	1,500,000	149,970,801.22	2.85
3	071404005	14国债(9期)	1,500,000	149,983,309.76	2.85
4	130214	13国债14	1,300,000	129,984,615.55	2.47
5	041459007	14国债(集优)	1,200,000	119,831,194.72	2.28
6	10026	10国债26	1,100,000	109,123,678.98	2.07
7	140316	14国债16	1,000,000	98,023,527.60	1.86
8	071415003	14国债(9期)	900,000	89,983,727.60	1.71
9	041364027	13国债(9期)	900,000	89,912,696.28	1.71
10	071404003	14国债(9期)	800,000	79,987,309.84	1.52

(六) 报告期内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	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(%)
1	011409001	14国债(8期)	1,500,000	150,000,109.21	2.85
2	011404004	14国债(9期)	1,500,000	149,970,801.22	2.85
3	071404005	14国债(9期)	1,500,000	149,983,309.76	2.85
4	130214	13国债14	1,300,000	129,984,615.55	2.47
5	041459007	14国债(集优)	1,200,000	119,831,194.72	2.28
6	10026	10国债26	1,100,000	109,123,678.98	2.07
7	140316	14国债16	1,000,000	98,023,527.60	1.86
8	071415003	14国债(9期)	900,000	89,983,727.60	1.71
9	041364027	13国债(9期)	900,000	89,912,696.28	1.71
10	071404003	14国债(9期)	800,000	79,987,309.84	1.52

(七) 报告期内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	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(%)
1	011409001	14国债(8期)	1,500,000	150,000,109.21	2.85
2	011404004	14国债(9期)	1,500,000	149,970,801.22	2.85
3	071404005	14国债(9期)	1,500,000	149,983,309.76	2.85
4	130214	13国债14	1,300,000	129,984,615.55	2.47
5	041459007	14国债(集优)	1,200,000	119,831,194.72	2.28
6	10026	10国债26	1,100,000	109,123,678.98	2.07
7	140316	14国债16	1,000,000	98,023,527.60	1.86
8	071415003	14国债(9期)	900,000	89,983,727.60	1.71
9	041364027	13国债(9期)	900,000	89,912,696.28	1.71
10	071404003	14国债(9期)	800,000	79,987,309.84	1.52

(八) 报告期内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	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(%)
1	011409001	14国债(8期)	1,500,000	150,000,109.21	2.85
2	011404004	14国债(9期)	1,500,000	149,970,801.22	2.85
3	071404005	14国债(9期)	1,500,000	149,983,309.76	2.85
4	130214	13国债14	1,300,000	129,984,615.55	2.47
5	041459007	14国债(集优)	1,200,000	119,831,194.72	2.28
6	10026	10国债26	1,100,000	109,123,678.98	2.07
7	140316	14国债16	1,000,000	98,023,527.60	1.86
8	071415003	14国债(9期)	900,000	89,983,727.60	1.71
9	041364027	13国债(9期)	900,000	89,912,696.28	1.71
10	071404003	14国债(9期)	800,000	79,987,309.84	1.52

(九) “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
报告期内偏离度绝对值0.25%以内(含0.25%)的情况	0次
报告期内偏离度绝对值0.25%以上的情况	0.18%
报告期内偏离度绝对值0.5%以上的情况	0.01%
报告期末偏离度绝对值0.5%以上的情况	0.10%

(十) 报告期内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	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(%)
1	011409001	14国债(8期)	1,500,000	150,000,109.21	2.85
2	011404004	14国债(9期)	1,500,000	149,970,801.22	2.85
3	071404005	14国债(9期)	1,500,000	149,983,309.76	2.85
4	130214	13国债14	1,300,000	129,984,615.55	2.47
5	041459007	14国债(集优)	1,200,000	119,831,194.72	2.28
6	10026	10国债26	1,100,000	109,123,678.98	2.07
7	140316	14国债16	1,000,000	98,023,527.60	1.86
8	071415003	14国债(9期)	900,000	89,983,727.60	1.71
9	041364027	13国债(9期)	900,000	89,912,696.28	1.71
10	071404003	14国债(9期)	800,000	79,987,309.84	1.52

(十一) 报告期内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	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(%)
1	011409001	14国债(8期)	1,500,000	150,000,109.21	2.85
2	011404004	14国债(9期)	1,500,000	149,970,801.22	2.85
3	071404005	14国债(9期)	1,500,000	149,983,309.76	2.85
4	130214	13国债14	1,300,000	129,984,615.55	2.47
5	041459007	14国债(集优)			