

## §5 投资组合报告

### 5.1 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	2,593,258,984.06	55.93
	其中:债券	2,593,258,984.06	55.93
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,857,600,000.00	40.06
	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	171,025,335.87	3.69
4	其他各项资产	15,036,825.62	0.32
5	合计	4,636,921,145.55	100.00

### 5.2 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	-	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金未出现投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

### 5.3.2 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 资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金 资产净值的比例 (%)
1	30天以内	52.56	0.65
	其中：剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.20	-
	其中：剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	10.40	-
	其中：剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	13.37	-
	其中：剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	8.92	-
	其中：剩余存续期超过397	-	-

	天的浮动利率债		
	合计	100.44	0.65

#### 5.4 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	1,376,901,020.29	29.92
3	金融债券	985,955,182.01	21.42
	其中：政策性金融债	985,955,182.01	21.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	230,402,781.76	5.01
6	其他	-	-
7	合计	2,593,258,984.06	56.35
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 5.5 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1001026	10央行票据26	2,500,000	249,892,707.19	5.43
2	0901040	09央行票据40	2,500,000	249,158,302.83	5.41
3	090223	09国开23	2,400,000	239,949,816.49	5.21
4	0901038	09央行票据	2,300,000	229,405,436.80	4.99

		38			
5	0901036	09央行票据 36	2,200,000	219,484,442.59	4.77
6	090218	09国开18	1,850,000	184,991,643.12	4.02
7	050413	05农发13	1,600,000	160,362,070.78	3.48
8	070413	07农发13	1,500,000	150,063,072.69	3.26
9	1081044	10铁道CP01	1,400,000	140,286,181.81	3.05
10	0901042	09央行票据 42	1,300,000	129,511,160.80	2.81

#### 5.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0362%
报告期内偏离度的最低值	-0.0637%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0301%

#### 5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.8 投资组合报告附注

##### 5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产

净值。

5.8.2 报告期内本基金未存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	35,948.89
3	应收利息	14,248,223.72
4	应收申购款	752,653.01
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,036,825.62

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。