

(上接B005版)

本基金合同约定“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”，本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限不超过120天的情况。

2.报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	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	37.02	0.05	
	其中：剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-	
2	30天-60天	35.43	-	
	其中：剩余期限超过97天的浮动利率债	11.76	-	
3	60天(含)-90天	14.41	-	
	其中：剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-	
4	90天(含)-180天	11.89	-	
	其中：剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-	
5	180天(含)-399天(含)	-	-	
	其中：剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-	
	合计	98.75	0.05	

(四)报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资情况

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	-	-
3	金融债券	199,206,620.45	47.32
	其中：政策性银行债	199,206,620.45	47.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,744,451.81	23.93
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	299,951,072.26	71.25
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债	49,509,960.10	11.76
	合计	98.75	0.05

(五)报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资情况

序号	债券代码	债券名称	债券面值(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140403	14农发债03	1,000,000.00	999,639,972.27	23.67
2	140410	14农发010	500,000.00	505,681,080.18	11.89
3	110222	11国开12	400,000.00	409,590,960.10	11.76
4	041356049	13国开债CP002	300,000.00	30,436,190.95	0.72
5	041358049	13国开CP003	300,000.00	32,226,743.45	0.78
6	041362041	13国开CP001	300,000.00	30,061,189.12	0.74
7	041362049	13国开CP002	100,000.00	10,018,329.29	0.28

(六)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

报告期末按摊余成本法计算的基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资情况

序号	债券代码	债券名称	债券面值(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140403	14农发债03	1,000,000.00	999,639,972.27	23.67
2	140410	14农发010	500,000.00	505,681,080.18	11.89
3	110222	11国开12	400,000.00	409,590,960.10	11.76
4	041356049	13国开债CP002	300,000.00	30,436,190.95	0.72
5	041358049	13国开CP003	300,000.00	32,226,743.45	0.78
6	041362041	13国开CP001	300,000.00	30,061,189.12	0.74
7	041362049	13国开CP002	100,000.00	10,018,329.29	0.28

(七)报告期末按摊余成本法计算的基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资情况

截至2014年10月13日，本基金未持有资产支持证券。

(八)报告期内组合报告

1.基金的市场价值

2.基金的估值方法

3.基金的估值差额

4.基金持有的证券

5.基金的估值方法

6.基金的估值差额

7.基金的估值方法

8.基金的估值方法

9.基金的估值方法

10.基金的估值方法

11.基金的估值方法

12.基金的估值方法

13.基金的估值方法

14.基金的估值方法

15.基金的估值方法

16.基金的估值方法

17.基金的估值方法

18.基金的估值方法

19.基金的估值方法

20.基金的估值方法

21.基金的估值方法

22.基金的估值方法

23.基金的估值方法

24.基金的估值方法

25.基金的估值方法

26.基金的估值方法

27.基金的估值方法

28.基金的估值方法

29.基金的估值方法

30.基金的估值方法

31.基金的估值方法

32.基金的估值方法

33.基金的估值方法

34.基金的估值方法

35.基金的估值方法

36.基金的估值方法

37.基金的估值方法

38.基金的估值方法

39.基金的估值方法

40.基金的估值方法

41.基金的估值方法

42.基金的估值方法

43.基金的估值方法

44.基金的估值方法

45.基金的估值方法

46.基金的估值方法

47.基金的估值方法

48.基金的估值方法

49.基金的估值方法

50.基金的估值方法

51.基金的估值方法

52.基金的估值方法

53.基金的估值方法

54.基金的估值方法

55.基金的估值方法

56.基金的估值方法

57.基金的估值方法

58.基金的估值方法

59.基金的估值方法

60.基金的估值方法

61.基金的估值方法

62.基金的估值方法

63.基金的估值方法

64.基金的估值方法

65.基金的估值方法

66.基金的估值方法

67.基金的估值方法

68.基金的估值方法

69.基金的估值方法

70.基金的估值方法

71.基金的估值方法

72.基金的估值方法

73.基金的估值方法

74.基金的估值方法

75.基金的估值方法

76.基金的估值方法

77.基金的估值方法

78.基金的估值方法

79.基金的估值方法

80.基金的估值方法

81.基金的估值方法

82.基金的估值方法

83.基金的估值方法

84.基金的估值方法

85.基金的估值方法

86.基金的估值方法

87.基金的估值方法

88.基金的估值方法

89.基金的估值方法

90.基金的估值方法

91.基金的估值方法

92.基金的估值方法

93.基金的估值方法

94.基金的估值方法

95.基金的估值方法

96.基金的估值方法

97.基金的估值方法

98.基金的估值方法