

## (上接B070版)

基金的投资组合将遵循以下限制：  
 (1)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；  
 (2)本基金与基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；  
 (3)存款类仅限于有证券投资基金管理资格、证券投资基金销售业务资格以及合格境外机构投资者资质的商业银行。本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的5%，协议约定提前支取且没有息票的银行存款，可不受此限制；

(4)本基金存放于具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的20%，存放于具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；  
 (5)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；  
 (6)投资于同一公司发行的短期企业债券和短期融资券的比例，不得超过基金资产净值的10%；  
 (7)除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%；

(8)本基金持有的剩余期限不超过397天的剩余存续期超过397天的浮动利率债券的公允价值合计不得高于当日基金资产净值的20%。本基金不得投资于定期存款利率基准的浮动利率债券；  
 (9)买入或卖出回购金融资产包基础货币的剩余期限不得低于397天；  
 (10)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券的比值，不得超过该基金持有的全部资产支持证券的比值，不得超过基金资产净值的20%；  
 (11)本基金投资于信用等级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如其信用评级下降至AA级以下的，基金管理人应及时评级和跟踪评级，应立即采取相应的应对措施；  
 (12)本基金投资的短期债券的信用评级不低于AA级；  
 (13)全国信用评级机构评定的A-级或相当于A-级的短期信用评级；  
 (14)根据有关规定评定的AA级以上信用评级的长期信用评级；  
 (15)全国信用评级机构评定的AA级以上信用评级的长期信用评级；  
 (16)全国信用评级机构评定的AA级以上信用评级的长期信用评级；  
 (17)除发生巨额赎回情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%；  
 (18)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券的比值，不得超过该基金持有的全部资产支持证券的比值，不得超过基金资产净值的20%；  
 (19)买入或卖出回购金融资产包基础货币的剩余期限不得低于397天；  
 (20)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金持有的全部资产支持证券的比值，不得超过该基金持有的全部资产支持证券的比值，不得超过基金资产净值的20%。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的情况说明  
 本基金定期报告“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，本基金未发生超标情况。

## (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	19.44	-
其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-	-
2	30天(含)-60天	35.26	-
其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-	-
3	60天(含)-90天	26.52	-
其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-	-
5	180天(含)-397天(含)	17.66	-
其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-	-
6	397天以上	-	-
其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-	-
合计		98.87	-

## 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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	10,014,095.35	17.66
4	其他	10,014,095.35	17.66
5	企业短期融资券	5,039,609.86	8.88
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合 计	18,053,705.21	26.54

## 5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债务代码	债务名称	摊余成本(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	140212	14国开12	100,000	10,014,095.35
2	04136013	13山水永01	50,000	5,039,609.86
3				
4				
5				
6				
7				
8				
9				
10				

## 6.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

## 7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 8.报告期末持有的债券投资总额

## 9.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 10.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 11.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 12.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 13.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 14.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 15.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 16.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 17.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 18.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 19.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 20.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 21.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 22.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 23.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 24.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 25.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 26.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 27.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 28.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 29.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 30.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 31.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 32.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 33.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 34.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 35.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 36.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 37.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 38.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 39.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 40.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 41.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 42.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 43.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 44.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 45.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 46.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 47.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 48.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 49.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 50.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 51.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 52.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 53.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 54.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 55.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 56.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 57.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 58.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 59.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 60.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 61.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 62.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 63.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 64.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 65.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 66.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 67.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 68.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 69.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 70.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 71.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 72.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 73.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 74.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 75.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 76.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 77.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 78.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 79.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 80.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 81.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 82.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 83.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 84.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 85.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 86.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 87.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 88.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 89.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

## 90.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券