

(上接B022版)

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	696,367,856.67	0.66		
2	央行票据	-	-		
3	金融债券	5,500,450,569.09	6.11		
4	企业债券	5,509,450,569.09	6.11		
5	企业短期融资券	500,195,375.66	0.65		
6	中期票据	23,974,766,108.58	26.60		
7	其他	1,271,912,422.59	1.41		
8	合计	31,941,662,250.59	35.43		
9	剩余存续期限超过397天的浮息债券	820,692,826.20	0.91		
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	140443	14农发债43	13,000,000	1,300,316,096.63	1.44
2	140223	14国开债23	8,900,000	890,754,425.29	0.99
3	020079	15银行债06	6,000,000	595,357,856.67	0.66
4	071503006	C150006	5,300,000	530,532,732.66	0.59
5	041564026	15中行债C15002	5,000,000	502,297,130.50	0.56
6	140444	14农发债44	5,000,000	499,930,932.00	0.56
7	100236	10农开债36	4,800,000	479,591,616.23	0.53
8	10061209	10中行债MTN01	3,800,000	382,013,765.56	0.42
9	011502006	SC150006	3,700,000	369,877,029.77	0.41
10	011506001	15农银债	3,600,000	369,716,353.44	0.40

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	27
报告期内偏离度的最高值	0.3818%
报告期内偏离度的最低值	0.01233%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均数	0.2412%

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

注:本基金报告期末未持有资产支持证券。

8 报价组合报告附注

8.1 本基金基于“摊余成本法”计价,即日计价对象以买入成本列入,按票面利率或定利率和考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于307天但剩余存续期限超过307天的浮动利率债券,但不存在该类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。

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。

8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	651,892,032.09
4	应收申购款	1,422,394,130.88
5	其他应收款	2,662,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,077,338,163.99

## § 12 基金业绩

基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

A 级

阶段	份额净值 收益率(%) (1)	份额净值 收益率 标准差(2)	业绩比较 基准收益 率(3)	业绩比较 基准收益 率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2004.35- 2004.12.31	2.26%	0.16%	1.32%	0.00%	0.94%	0.16%
2005.1.1- 2005.12.31	2.4948%	0.0027%	1.8000%	0.0003%	0.6948%	0.0024%
2006.1.1- 2006.12.31	1.9638%	0.0119%	1.8300%	0.0005%	0.0538%	0.0014%
2007.1.1- 2007.12.31	3.2640%	0.046%	2.7150%	0.0018%	0.5400%	0.0028%
2008.1.1- 2008.12.31	3.9326%	0.0148%	3.1080%	0.0032%	0.5246%	0.0116%
2009.1.1- 2009.12.31	1.7435%	0.0069%	1.3781%	0.0001%	0.3684%	0.0006%
2010.1.1- 2010.12.31	2.1458%	0.0039%	1.5781%	0.0001%	0.7677%	0.0039%
2011.1.1- 2011.12.31	4.0274%	0.0030%	1.4900%	0.0001%	2.5365%	0.0029%
2012.1.1- 2012.12.31	4.3096%	0.0032%	1.4657%	0.0002%	2.8531%	0.0030%
2013.1.1- 2013.12.31	4.3637%	0.0029%	1.3781%	0.0000%	2.9856%	0.0029%
2014.1.1- 2014.12.31	4.9648%	0.0021%	1.3781%	0.0000%	3.5967%	0.0021%
2015.1.1- 2015.6.30	2.1721%	0.0026%	0.6010%	0.0000%	1.4911%	0.0026%
自基金合同生效至 至今	44.6356%	0.0063%	21.9966%	0.0019%	22.6306%	0.0044%

注:本基金收益分配为按月结转份额。

B 级

阶段	份额净值 收益率 (1)	份额净值 收益率 标准差(2)	业绩比较 基准收益 率(3)	业绩比较 基准收益 率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2009.12.31- 2009.12.31	1.0266%	0.0006%	0.6003%	0.0000%	0.4172%	0.0006%
2010.1.1- 2010.12.31	2.5907%	0.0030%	1.3781%	0.0000%	1.0126%	0.0030%
2011.1.1- 2011.12.31	4.2760%	0.0030%	1.4900%	0.0001%	2.7851%	0.0029%
2012.1.1- 2012.12.31	4.5688%	0.0032%	1.4657%	0.0002%	3.1031%	0.0030%
2013.1.1- 2013.12.31	4.6133%	0.0020%	1.3781%	0.0000%	3.2286%	0.0029%
2014.1.1- 2014.12.31	5.2157%	0.0021%	1.3781%	0.0000%	3.8376%	0.0021%
2015.1.1- 2015.6.30	2.2935%	0.0026%	0.6810%	0.0000%	1.6125%	0.0026%
自基金合同生效起 至今	26.9835%	0.0048%	8.6693%	0.0002%	18.3142%	0.0046%

注:本基金收益分配为按月结转份额。

B 级

阶段	份额净值 收益率 (1)	份额净值 收益率 标准差(2)	业绩比较 基准收益 率(3)	业绩比较 基准收益 率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2009.12.31- 2009.12.31	1.0266%	0.0006%	0.6003%	0.0000%	0.4172%	0.0006%
2010.1.1- 2010.12.31	2.5907%	0.0030%	1.3781%	0.0000%	1.0126%	0.0030%
2011.1.1- 2011.12.31	4.2760%	0.0030%	1.4900%	0.0001%	2.7851%	0.0029%
2012.1.1- 2012.12.31	4.5688%	0.0032%	1.4657%	0.0002%	3.1031%	0.0030%
2013.1.1- 2013.12.31	4.6133%	0.0020%	1.3781%	0.0000%	3.2286%	0.0029%
2014.1.1- 2014.12.31	5.2157%	0.0021%	1.3781%	0.0000%	3.8376%	0.0021%
2015.1.1- 2015.6.30	2.2935%	0.0026%	0.6810%	0.0000%	1.6125%	0.0026%
自基金合同生效起 至今	44.6356%	0.0063%	21.9966%	0.0019%	22.6306%	0.0044%

注:本基金收益分配为按月结转份额。

B 级

阶段	份额净值 收益率 (
----	------------------