

B347

[illegible][illegible]

金额单位:人民币元									
债券代码	债券名称	到期日期	期末估值单价	数量(张)	期末公允价值				
120027	12国债27	2015年7月1日	100.29	1,400,000	140,406,326.68				
110221	11国债21	2015年7月1日	100.26	600,000	60,166,720.00				
0.13.0.32 交易所市场债券正回购									
本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。									
11.0.7 有助于期限和会计匹配原则的说明和解释分析其他事项									
本基金报告期内无需要说明的与期限分析有财务影响的其它事项。									
§7 投资组合报告									
7.1 期末基金资产组合情况									
金额单位:人民币元									
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)						
1	固定收益投资	9,693,356,422.13	28.27						
	其中:债券	9,693,356,422.13	28.27						
	资产支持证券	-	-						
2	买入返售金融资产	12,413,576,517.18	36.2						
	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	11,904,222,547.90	34.72						
4	其他各项资产	277,321,480.62	0.81						
5	合计	34,288,480,367.84	100						
7.2 债券资产组合情况									
金额单位:人民币元									
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)						
1	报告期内债券正回购余额	-	1.42						
	其中:买断式回购融资	-	-						
2	报告期末债券的投资余额	196,999,702.00	-						
	其中:买断式回购融资	-	0.58						
注:报告期内债券正回购余额与基金资产净值的比例为报告期内每个交易日债券投资余额占基金资产净值比例的最高单平均值。									
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%。									
7.3 基金投资组合平均剩余期限									
7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况									
报告期末投资组合平均剩余期限		天数							
报告期末投资组合平均剩余期限		90							
报告期末投资组合平均剩余期限最高值		109							
报告期末投资组合平均剩余期限最低值		68							
报告期末投资组合平均剩余期限超过180天情况说明									
本基金报告期内,“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”,在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。									
7.3.2 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	23.62	0.68						
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	0.64	-						
2	30天(含)-60天	9.26	-						
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-						
3	60天(含)-90天	45.13	-						
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-						
4	90天(含)-180天	9.36	-						
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	0.41	-						
5	180天(含)-397天(含)	12.04	-						
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-						
	合计	99.02	0.68						
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合									
金额单位:人民币元									
序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)						
1	国债券种	-	-						
2	央行票据	-	-						
3	金融债	2,026,262,606.41	5.94						
	其中:政策性金融债	2,026,262,606.41	5.94						
4	企业债	-	-						
5	企业短期融资券	7,668,147,816.72	22.60						
6	中期票据	-	-						
7	其他	-	-						
8	合计	9,693,356,422.13	28.46						
9	报告期内债券超过30天且未到期未偿债券	359,687,521.36	1.06						
7.5 期末按摊余成本法基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合明细									
金额单位:人民币元									
序号	债券代码	债券名称	债券余额	摊余成本	占基金资产净值比例(%)				
1	01472006	14国债增债C001	5,000,000	500,000,046.88	1.47				
2	100326	10国债附36	4,500,000	461,822,506.00	1.33				
3	041801318	14国债附362	3,500,000	368,088,792.42	1.03				
4	190402	19国债附2	3,100,000	312,059,443.83	0.92				
5	01174607	14国债附2C007	3,000,000	299,976,004.04	0.88				
6	01159508	15国债附2C002	3,000,000	299,949,923.00	0.87				
7	041556023	15开债附2C002	3,000,000	299,544,676.39	0.87				
8	011551001	15中债附2C001	2,300,000	229,856,166.87	0.67				
9	011489066	14国债附2C002	2,100,000	209,959,055.21	0.62				
10	011574003	15国债附2C003	2,000,000	199,568,024.62	0.59				
7.6 “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%-0.5%间的次数		7							
报告期内偏离度的最高值		0.2708%							
报告期内偏离度的最低值		-0.0722%							
报告期内偏离度绝对值超过0.5%的次数		0.1228%							
7.7 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8 投资组合报告附注									
7.8.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5 投资组合报告附注									
7.8.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5 投资组合报告附注									
7.8.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5 投资组合报告附注									
7.8.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5 投资组合报告附注									
7.8.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5 投资组合报告附注									
7.8.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.3 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									
7.8.5.4 期末公允价值占基金资产净值比例大小排序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。									
7.8.5 投资组合报告附注									
7.8.5.1 本基金未持有信用类成本法。因持有对象以公允价值计价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日计提使基金余额维持在1,000元内。									
7.8.5.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限超过397天且未到期未偿债券的摊余成本超过当日基金资产净值的30%的情况。									

招商基金管理有限公司
2015年9月26日