

(上接 C224 版)

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		82	
报告期内投资组合平均剩余期限最高值		98	
报告期内投资组合平均剩余期限最低值		32	
报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明			
本基金本报告期不存在投资组合平均剩余期限超过 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	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	31.55	4.30
其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债			
2	30 天(含)-60 天	15.57	-
其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债			
3	60 天(含)-90 天	21.77	-
其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债			
4	90 天(含)-120 天	7.81	-
其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债			
5	120 天(含)-397 天(含)	27.51	-
其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债			
合计	104.20	4.30	

(四) 报告期内投资组合平均剩余期限超过 240 天情况说明

报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

(五) 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	-	-
3	金融债券	33,084,181.65	5.16
其中:政策性金融债			
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,020,191.59	6.25
6	中期票据	-	-
7	同业存单	332,249,433.09	51.87
8	其他	-	-
9	合计	405,353,806.33	63.28
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

(六) 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	111909061	19 浦发银行 CD061	500,000	49,722,570.98	7.76
2	111984398	19 招商银行 CD050	500,000	49,471,167.46	7.72
3	111982662	19 广州银行 CD040	300,000	29,961,588.30	4.68
4	111916346	19 上海银行 CD346	300,000	29,879,166.22	4.66
5	111918102	19 华夏银行 CD102	300,000	29,807,155.69	4.65
6	011902944	19 大同煤矿 SCP023	200,000	20,011,728.66	3.12
7	111918022	19 华夏银行 CD102	200,000	19,967,003.52	3.12
8	111985314	19 长沙银行 CD157	200,000	19,917,809.45	3.11
9	111997660	19 厦门国际银行 CD068	150,000	14,828,080.38	2.31
10	150313	15 进出口 13	130,000	13,062,117.20	2.04

(七) “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1321%
报告期内偏离度的最低值	-0.0080%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0351%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金报告期内不存在偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

(八) 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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	159992	19 华安 03A1(总份)	100,000	10,001,000.00	1.56
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

(九) 投资组合报告附注

1. 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

2. 本基金投资的 19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况

19 浦发银行 CD061(111909061.BB)发行人的相关情况