

(上接 C37 版)

客户服务电话:95391/4008005000 网址:www.ftzq.com 52 万联证券股份有限公司 注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场E座18、19层

法定代表人:刘建武 联系人:梁承华 客户服务电话:95582 网址:www.westsec.com 55 西南证券股份有限公司 注册地址:重庆市江北桥北苑8号

法定代表人:孙永祥 联系人:李欣 客户服务电话:95351 网址:www.xcsc.com 57 新时代证券股份有限公司 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人:叶顺德 联系人:田芳宇 客户服务电话:95399 网址:www.xsdcq.cn 59 信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:尹旭刚 联系人:尹旭刚 客户服务电话:95321 网址:www.cindasc.com 59 兴业证券股份有限公司 注册地址:福州市湖东路268号

法定代表人:兰荣根 联系人:陈珊珊 客户服务电话:95354 网址:www.stocke.com.cn 63 中国国际金融股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:毕明德(代) 联系人:杨雨宇 客户服务电话:4009101166 网址:www.cicc.com.cn 64 中国民族证券有限责任公司 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40-43层

法定代表人:何亚刚 联系人:胡刚 客户服务电话:40088-95618 网址:www.c5618.com 65 中国银河证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人:陈共炎 联系人:李国柱 客户服务电话:4008-888-95551 网址:www.chinastock.com.cn 66 中国中投证券有限责任公司 注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23层

联系人:王笑宇 客户服务热线:95055-9 网址:https://www.baiyingsfund.com/ 2)北京董垂基金销售有限公司 注册地址:北京市朝阳区阜通东大街7号院6号楼2单元21层222507

法定代表人:王瑞军 联系人:甘蕾 客户服务电话:400888133 网址:www.wkzq.com.cn 53 广证证券有限责任公司 注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

法定代表人:赵立功 联系人:马国栋 客户服务电话:4001840028 网址:www.wkzq.com.cn 54 西部证券股份有限公司 注册地址:西安市新城区东大街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武 联系人:梁承华 客户服务电话:95582 网址:www.westsec.com 55 西南证券股份有限公司 注册地址:重庆市江北桥北苑8号

法定代表人:孙永祥 联系人:李欣 客户服务电话:95351 网址:www.xcsc.com 57 新时代证券股份有限公司 注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人:叶顺德 联系人:田芳宇 客户服务电话:95399 网址:www.xsdcq.cn 59 信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:尹旭刚 联系人:尹旭刚 客户服务电话:95321 网址:www.cindasc.com 59 兴业证券股份有限公司 注册地址:福州市湖东路268号

法定代表人:兰荣根 联系人:陈珊珊 客户服务电话:95354 网址:www.stocke.com.cn 63 中国国际金融股份有限公司 注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:毕明德(代) 联系人:杨雨宇 客户服务电话:4009101166 网址:www.cicc.com.cn 64 中国民族证券有限责任公司 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40-43层

网址:www.yicinfund.com 27 浙江同花顺基金销售有限公司 注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903 办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大厦

法定代表人:宋晓军 联系人:李海 客户服务电话:4008769988 网址:www.zsfund.com 29 珠海盈米基金销售有限公司 注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人:肖雯 联系人:黄敏 客户服务电话:020-89629066 网址:www.yingmi.com 基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实际,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构,并在基金管理人网站公示

名称:中国证券投资基金结算有限责任公司 住所:北京市西城区太平桥大街17号 法定代表人:周明 办公室地址:北京市西城区太平桥大街17号

名称:北京德恒律师事务所 住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层 法定代表人:王丽 办公室地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 法定代表人:李丹 办公室地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

名称:上海浦东发展银行股份有限公司 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 法定代表人:李丹 办公室地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

名称:上海浦东发展银行股份有限公司 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 法定代表人:李丹 办公室地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

名称:上海浦东发展银行股份有限公司 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 法定代表人:李丹 办公室地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

2. 报告期债券回购融资情况 序号 项目 占基金资产净值比例(%) 1 报告期内债券回购融资余额 2.15

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值的简单平均值。 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明 注: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%。

(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 74

(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(%)

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 国债券种 -

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。 5. 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明细

序号 债券代码 债券名称 国家(地区) 数量(张) 摊余成本 占基金资产净值比例(%) 1 111908039 19 中信银行 CD039 3,000.00 298,153,219.08 8.10

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% 之间的次数 -

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资产支持证券投资明细 注:无。

8. 投资组合报告附注 (1) 基金持有的银行承兑以本列示,按银行实际协议利率逐日计提利息。

(3) 其他资产构成 序号 名称 金额(人民币元) 1 存出保证金 -

(4) 投资组合报告附注的其他文字描述部分 1. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

2. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

3. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

4. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

5. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

6. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

7. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

8. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

9. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

10. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

11. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

12. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

13. 本基金的投资决策流程主要包括:长期决策、期限结构策略、资产配置策略和个券选择策略。

2012年01月01日至2012年12月31日 4,0791 0.0034 0.4201 0.0002 3,6590 0.0032 % % % % % %

2013年01月01日至2013年12月31日 4,0278 0.0045 0.3500 0.0000 3,6778 0.0045 % % % % % %

2014年01月01日至2014年12月31日 4,3233 0.0047 0.3500 0.0000 3,9733 0.0047 % % % % % %

2015年01月01日至2015年12月31日 3,5556 0.0040 0.3500 0.0000 3,0056 0.0040 % % % % % %

2016年01月01日至2016年12月31日 2,4498 0.0007 0.3510 0.0000 2,0988 0.0007 % % % % % %

2017年01月01日至2017年12月31日 3,6418 0.0011 0.3500 0.0000 3,2918 0.0011 % % % % % %

2018年01月01日至2018年12月31日 3,3004 0.0019 0.3500 0.0000 2,9504 0.0019 % % % % % %

2019年01月01日至2019年03月31日 0,6285 0.0010 0.0863 0.0000 0,5422 0.0010 % % % % % %

2020年01月01日至2020年03月31日 52,2263 0.0047 9,8637 0.0019 42,3626 0.0028 % % % % % %

2005年04月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日 1,4714 0.0038 1,3019 0.0000 0,1695 0.0038 % % % % % %

2006年01月01日至2006年12月31日 1,8650 0.0037 1,8799 0.0003 -0,0149 0.0034 % % % % % %

2007年01月01日至2007年12月31日 3,9768 0.0079 2,2252 0.0024 1,7516 0.0055 % % % % % %

2008年01月01日至2008年12月31日 3,4478 0.0046 0,6596 0.0003 2,7882 0.0043 % % % % % %

2009年01月01日至2009年12月31日 1,7144 0.0040 0,3600 0.0000 1,3544 0.0040 % % % % % %

2010年01月01日至2010年12月31日 2,0367 0.0038 0,3600 0.0000 1,6767 0.0038 % % % % % %

2011年01月01日至2011年12月31日 3,6910 0.0032 0,4697 0.0001 3,2213 0.0031 % % % % % %

2012年01月01日至2012年12月31日 4,3284 0.0034 0,4201 0.0002 3,9083 0.0032 % % % % % %

2013年01月01日至2013年12月31日 4,2766 0.0045 0,3500 0.0000 3,9266 0.0045 % % % % % %

2014年01月01日至2014年12月31日 4,5732 0.0047 0,3500 0.0000 4,2232 0.0047 % % % % % %

2015年01月01日至2015年12月31日 3,6038 0.0040 0,3500 0.0000 3,2538 0.0040 % % % % % %

2016年01月01日至2016年12月31日 2,6954 0.0007 0,3510 0.0000 2,3444 0.0007 % % % % % %

2017年01月01日至2017年12月31日 3,8912 0.0011 0,3500 0.0000 3,5412 0.0011 % % % % % %

2018年01月01日至2018年12月31日 3,5481 0.0019 0,3500 0.0000 3,1981 0.0019 % % % % % %

2019年01月01日至2019年03月31日 0,6879 0.0010 0,0863 0.0000 0,6016 0.0010 % % % % % %

2020年01月01日至2020年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

基金合同生效日至2019年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

2005年04月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日 1,4714 0.0038 1,3019 0.0000 0,1695 0.0038 % % % % % %

2006年01月01日至2006年12月31日 1,7913 0.0037 1,8799 0.0003 -0,0886 0.0034 % % % % % %

2007年01月01日至2007年12月31日 3,7287 0.0079 2,2252 0.0024 1,5035 0.0055 % % % % % %

2008年01月01日至2008年12月31日 3,2016 0.0046 0,6596 0.0003 2,5420 0.0043 % % % % % %

2009年01月01日至2009年12月31日 1,4697 0.0040 0,3600 0.0000 1,1097 0.0040 % % % % % %

2010年01月01日至2010年12月31日 1,7925 0.0038 0,3600 0.0000 1,4325 0.0038 % % % % % %

2011年01月01日至2011年12月31日 3,4432 0.0032 0,4697 0.0001 2,9735 0.0031 % % % % % %

2012年01月01日至2012年12月31日 4,3284 0.0034 0,4201 0.0002 3,9083 0.0032 % % % % % %

2013年01月01日至2013年12月31日 4,2766 0.0045 0,3500 0.0000 3,9266 0.0045 % % % % % %

2014年01月01日至2014年12月31日 4,5732 0.0047 0,3500 0.0000 4,2232 0.0047 % % % % % %

2015年01月01日至2015年12月31日 3,6038 0.0040 0,3500 0.0000 3,2538 0.0040 % % % % % %

2016年01月01日至2016年12月31日 2,6954 0.0007 0,3510 0.0000 2,3444 0.0007 % % % % % %

2017年01月01日至2017年12月31日 3,8912 0.0011 0,3500 0.0000 3,5412 0.0011 % % % % % %

2018年01月01日至2018年12月31日 3,5481 0.0019 0,3500 0.0000 3,1981 0.0019 % % % % % %

2019年01月01日至2019年03月31日 0,6879 0.0010 0,0863 0.0000 0,6016 0.0010 % % % % % %

2020年01月01日至2020年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

基金合同生效日至2019年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

2005年04月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日 1,4714 0.0038 1,3019 0.0000 0,1695 0.0038 % % % % % %

2006年01月01日至2006年12月31日 1,7913 0.0037 1,8799 0.0003 -0,0886 0.0034 % % % % % %

2007年01月01日至2007年12月31日 3,7287 0.0079 2,2252 0.0024 1,5035 0.0055 % % % % % %

2008年01月01日至2008年12月31日 3,2016 0.0046 0,6596 0.0003 2,5420 0.0043 % % % % % %

2009年01月01日至2009年12月31日 1,4697 0.0040 0,3600 0.0000 1,1097 0.0040 % % % % % %

2010年01月01日至2010年12月31日 1,7925 0.0038 0,3600 0.0000 1,4325 0.0038 % % % % % %

2011年01月01日至2011年12月31日 3,4432 0.0032 0,4697 0.0001 2,9735 0.0031 % % % % % %

2012年01月01日至2012年12月31日 4,3284 0.0034 0,4201 0.0002 3,9083 0.0032 % % % % % %

2013年01月01日至2013年12月31日 4,2766 0.0045 0,3500 0.0000 3,9266 0.0045 % % % % % %

2014年01月01日至2014年12月31日 4,5732 0.0047 0,3500 0.0000 4,2232 0.0047 % % % % % %

2015年01月01日至2015年12月31日 3,6038 0.0040 0,3500 0.0000 3,2538 0.0040 % % % % % %

2016年01月01日至2016年12月31日 2,6954 0.0007 0,3510 0.0000 2,3444 0.0007 % % % % % %

2017年01月01日至2017年12月31日 3,8912 0.0011 0,3500 0.0000 3,5412 0.0011 % % % % % %

2018年01月01日至2018年12月31日 3,5481 0.0019 0,3500 0.0000 3,1981 0.0019 % % % % % %

2019年01月01日至2019年03月31日 0,6879 0.0010 0,0863 0.0000 0,6016 0.0010 % % % % % %

2020年01月01日至2020年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

基金合同生效日至2019年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

2005年04月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日 1,4714 0.0038 1,3019 0.0000 0,1695 0.0038 % % % % % %

2006年01月01日至2006年12月31日 1,7913 0.0037 1,8799 0.0003 -0,0886 0.0034 % % % % % %

2007年01月01日至2007年12月31日 3,7287 0.0079 2,2252 0.0024 1,5035 0.0055 % % % % % %

2008年01月01日至2008年12月31日 3,2016 0.0046 0,6596 0.0003 2,5420 0.0043 % % % % % %

2009年01月01日至2009年12月31日 1,4697 0.0040 0,3600 0.0000 1,1097 0.0040 % % % % % %

2010年01月01日至2010年12月31日 1,7925 0.0038 0,3600 0.0000 1,4325 0.0038 % % % % % %

2011年01月01日至2011年12月31日 3,4432 0.0032 0,4697 0.0001 2,9735 0.0031 % % % % % %

2012年01月01日至2012年12月31日 4,3284 0.0034 0,4201 0.0002 3,9083 0.0032 % % % % % %

2013年01月01日至2013年12月31日 4,2766 0.0045 0,3500 0.0000 3,9266 0.0045 % % % % % %

2014年01月01日至2014年12月31日 4,5732 0.0047 0,3500 0.0000 4,2232 0.0047 % % % % % %

2015年01月01日至2015年12月31日 3,6038 0.0040 0,3500 0.0000 3,2538 0.0040 % % % % % %

2016年01月01日至2016年12月31日 2,6954 0.0007 0,3510 0.0000 2,3444 0.0007 % % % % % %

2017年01月01日至2017年12月31日 3,8912 0.0011 0,3500 0.0000 3,5412 0.0011 % % % % % %

2018年01月01日至2018年12月31日 3,5481 0.0019 0,3500 0.0000 3,1981 0.0019 % % % % % %

2019年01月01日至2019年03月31日 0,6879 0.0010 0,0863 0.0000 0,6016 0.0010 % % % % % %

2020年01月01日至2020年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %

基金合同生效日至2019年03月31日 56,8696 0.0047 9,8637 0.0019 47,0059 0.0028 % % % % % %