

长城货币市场证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司 基金托管人:华夏银行股份有限公司

第一节 重要提示

长城货币市场证券投资基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2008年8月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

第二节 基金简介

(一) 基金基本情况

基金名称:长城货币市场证券投资基金
基金简称:长城货币市场基金
交易代码:200003
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2005年5月30日
报告期末基金份额总额:535,935,153.34份

(二) 基金投资基本情况

投资目标:在本金安全和足够流动性的前提下,寻求货币资产稳定的收益。
投资策略:在严格控制风险的前提下,保证资金的安全性和高流动性,通过积极主动的三级资产配置和投资组合管理实现收益的最大化。
业绩比较基准:本基金业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。
风险收益特征:本基金在证券投资基金中属于高流动性、低风险品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

(三) 基金管理人

名称:长城基金管理有限公司
信息披露负责人:彭洪波
联系电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
电子邮箱:support@cctfund.com.cn
名称:华夏银行股份有限公司(以下简称“华夏银行”)
信息披露负责人:郑鹏
联系电话:010-85239672
传真:010-85236880
电子邮箱:zhjngb@hx.com.cn

(四) 基金托管人

基金选定的信息披露报纸名称:中国证券报、上海证券报
登载半年度报告正文的互联网网址:www.cctfund.com.cn
基金半年度报告报备地点:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

(五) 主要财务指标

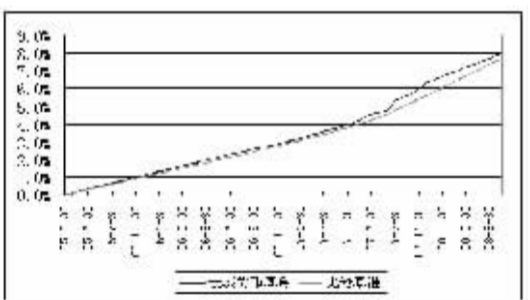
| 主要财务指标 | 报告期 (2008年1月1日至2008年6月30日) |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.本期利润 | 6,648,293.38 |
| 2.本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 6,648,293.38 |
| 3.本期基金净值 | 535,935,153.34 |
| 4.期末基金份额净值 | 1.0000 |
| 5.本期净利润率 | 1.4615% |
| 6.加权净利润率 | 7.9832% |

重要提示:本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。本基金的收益分配为按日结转基金份额。

(二) 基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.2647% | 0.0029% | 0.3233% | 0.0000% | -0.0586% | 0.0029% |
| 过去三个月 | 0.7477% | 0.0029% | 0.8806% | 0.0000% | -0.1329% | 0.0029% |
| 过去六个月 | 1.4615% | 0.0033% | 1.9611% | 0.0000% | -0.5000% | 0.0033% |
| 过去一年 | 3.5971% | 0.0068% | 3.6888% | 0.0012% | -0.0917% | 0.0056% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.9832% | 0.0061% | 7.6912% | 0.0023% | 0.2920% | 0.0038% |

2、长城货币市场基金自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注:(1)本基金合同约定,本基金的组合配置比例范围为:央行票据:0—80%,回购:0—70%,短期债券:0—80%,同业存款/现金:0—70%。本基金在投资运作中按照相关法律法规规定,严格遵守了基金合同的约定。

(2) 本基金业绩比较基准的选择符合基金合同、基金招募说明书的规定。

第三节 管理人报告

一、基金管理人及基金经营情况
1.基金管理人简介
长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券有限责任公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、北方国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2005年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构的调整,现有股东为长城证券有限责任公司(47.05%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托投资股份有限公司(17.647%)、中原信托投资有限公司(17.647%)。2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前,公司管理的基金有封闭式基金:久嘉证券投资基金;开放式基金:长城久嘉核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久盛中信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金和长城品牌优选股票型证券投资基金。

2.基金经理简介
刘海先生,CFA,清华大学经济学学士。曾就职于深圳发展银行总行,任债券交易员。2006年6月加入长城基金管理有限公司,任长城货币市场证券投资基金基金助理。2006年3月起任长城货币市场证券投资基金基金经理。
长城货币市场证券投资基金历任基金经理如下:黄瑞庆先生自2005年5月30日至2006年9月24日任基金经理,王定元先生自2006年9月25日至2006年3月8日任基金经理。

(二) 基金运作遵守信守情况声明
本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情形,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内运作过程中曾出现投资组合指标波动偏离度标准的情况,本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整,有效地保护了基金持有人利益。

(三) 公平交易专项说明
1.公平交易制度的执行情况
本报告期内本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定,各基金在研究支持、投资决策上享有公平的机会。
公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序,保证各基金获得了公平的交易机会。

2.本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
本基金为货币市场基金,投资风格与公司所管理的其他投资组合均不同。

3.异常交易行为的专项说明
本报告期内公司内部风险控制 and 监察稽核工作中未发现异常交易行为,未发现直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

(四) 投资策略和业绩表现说明及解释
1.基金业绩
报告期内,本基金净值收益率为1.4615%,较同期业绩比较基准低0.5096%。

(2) 操作回顾
2008年上半年,伴随着世界经济回暖,我国宏观经济增长也开始出现周期性放缓局面,CPI通胀率在2月份创下8.7%单月新高后不断下降,6月末已降至7.1%的水。上半年国家外汇储备增长18.4%至1.8万亿美元,显示出外部流动性输入压力依然较大,为了对冲疫情影响,央行上半年五次累计上调法定存款准备金率3个百分点。6月末商业银行超储率为1.95%,比去年末下降1.05%。而在房地产、股票等市场表现不佳的情况下,今年以来

存款明显向银行回流,同时贷款增长速度也有所放慢。

上半年我国货币市场的表现依然受到来自资金面变化和加息预期波动的影响,其中,每次准备金的上调几乎都使得货币市场利率出现一定程度的短期上涨,但随后又慢慢稳步回落。加息预期集中出现在5、6月份,从而引发了1年期利率的市场利率一度从4.06%最高升至4.13%左右,不过后续CPI的不断回落以及中央经济增速增长意愿的增强逐步打消了市场对加息的担忧,债券市场随之而下。另外,由于今年新股申购收益率显著降低,因此新股发行对货币市场利率的影响明显下降,这使得回购利率的波动程度也小于去年下半年。央行公开市场方面,其央票发行利率今年以来一直保持未变,从而也对货币市场总利率起到了稳定作用。

本基金在上半年延续了稳健的投资风格,投资标的以央票和金融债为主,始终将资产的安全性作为首要考虑。久期方面,我们根据市场形势动态进行调整,总体上比去年略有延长,从而实现了基金收益率的提升和稳定。

(五) 宏观经济及货币市场展望
我们预计下半年我国宏观经济仍将保持回落趋势,受总需求下降和上游成本挤压效应影响,企业利润增速继续降低,因此尽管目前仍处于负利率局面,但考虑到企业经营困难和经济周期因素,央行实际加息的空间很小,而且随着国际大宗商品价格进入了历史高价区间,其未来涨幅将十分有限甚至还会有所下跌,因此下半年通胀压力的缓解速度有可能超出预期,这将对于货币市场乃至债券市场形成利好推动影响。再从下半年的资金面看,三、四季度往往都是银行流动性逐步增加的时期,因此其对债券的配置需求也有望提高。总体而言,我们判断下半年货币市场债券价格走势可能会稳中有升,因此本基金将继续保持较长的久期,以充分获取这一收益。

第五节 托管人报告

托管人声明:在本报告期内,基金托管部严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关法律法规和基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

报告期内,基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用的开支等方面,严格遵守了基金合同有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人依法对基金半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,认为其真实、准确和完整。

第六节 财务会计报告(未经审计)

(一) 长城货币市场基金半年度财务报表
1. 长城货币市场基金2008年6月30日及2007年12月31日的比较式资产负债表

| 资产 | 2008年6月30日 | 2007年12月31日 |
|-----------|----------------|------------------|
| 货币资产 | 7,989,490.89 | 415,090.40 |
| 银行存款 | 1,074,678.97 | 4,187,851.69 |
| 存放同业款项 | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 其他货币资金 | 444,756,604.30 | 1,029,608,410.97 |
| 其中:政策性金融债 | 444,756,604.30 | 1,029,608,410.97 |
| 债券投资 | 444,756,604.30 | 1,029,608,410.97 |
| 资产支持证券投资 | -- | -- |
| 衍生金融资产 | -- | -- |
| 买入返售金融资产 | 49,400,164.10 | -- |
| 应收证券清算款 | 2,685.00 | -- |
| 应收利息 | 3,464,440.97 | 2,224,103.26 |
| 应收股利 | -- | -- |
| 应收申购款 | 32,297,969.70 | 169,519,517.77 |
| 其他资产 | -- | -- |
| 资产总计 | 539,501,425.21 | 1,206,085,573.47 |
| 负债: | -- | -- |
| 短期借款 | -- | -- |
| 交易性金融负债 | -- | -- |
| 衍生金融负债 | -- | -- |
| 卖出回购金融资产款 | -- | -- |
| 应付证券清算款 | -- | -- |
| 应付赎回款 | 2,403,207.66 | 129,249.97 |
| 应付管理人报酬 | 104,678.97 | 369,123.56 |
| 应付托管费 | 31,720.28 | 104,343.20 |
| 应付销售服务费 | 79,300.76 | 126,891.61 |
| 应付交易费用 | 8,177.03 | 14,874.48 |
| 应交税费 | -- | -- |
| 应付利息 | -- | -- |
| 应付利润 | 1,339,188.89 | 1,264,323.51 |
| 其他负债 | 3,566,217.89 | 1,799,346.62 |
| 负债合计 | 3,566,217.89 | 1,799,346.62 |
| 所有者权益: | 535,935,153.34 | 1,204,286,226.85 |
| 未分配利润 | 535,935,153.34 | 1,204,286,226.85 |
| 所有者权益合计 | 535,935,153.34 | 1,204,286,226.85 |
| 所有者权益总计 | 539,501,425.21 | 1,206,085,573.47 |

附注:基金份额净值1.0000元,基金份额总额535,935,153.34份。
2、 长城货币市场基金本报告期及上年度可比期间的比较式利润表

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------|--------------|--------------|
| 一、收入 | 8,797,303.21 | 9,196,046.08 |
| 1.利息收入 | 8,796,386.46 | 9,360,321.86 |
| 其中:存款利息收入 | 377,378.14 | 1,163,424.17 |
| 债券利息收入 | 7,573,840.05 | 5,289,644.53 |
| 买入返售金融资产收入 | -- | -- |
| 其他利息收入 | 845,668.26 | 2,907,253.16 |
| 2.投资收益 | 1,916.76 | -154,276.79 |
| 其中:股权投资收益 | -- | -- |
| 债券投资收益 | 1,916.76 | -154,276.79 |
| 资产支持证券投资收益 | -- | -- |
| 衍生工具收益 | -- | -- |
| 股利收益 | -- | -- |
| 公允价值变动收益 | -- | -- |
| 二、费用 | 2,149,083.03 | 2,693,921.07 |
| 1.销售费用 | 802,872.02 | 1,004,332.74 |
| 2.托管费 | 243,294.72 | 304,343.24 |
| 3.销售服务费 | 698,298.94 | 769,858.12 |
| 4.交易费用 | -- | -- |
| 利息支出 | 349,011.89 | 416,745.46 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 349,011.89 | 416,745.46 |
| 6.其他费用 | 146,673.96 | 197,632.41 |
| 三、利润总额 | 6,648,293.38 | 6,512,125.01 |

* 实行新的企业会计准则后,债券交易费用和回购交易费用计入成本,因为上期金额较小,根据重要性原则,不做追溯调整。

3. 长城货币市场基金本报告期及上年度可比期间的比较式所有者权益(基金净值)变动表

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------------------------|------------------|------------------|
| 一、期初所有者权益 | 1,203,306,216.06 | 1,462,597,154.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | 6,648,293.38 | 6,512,125.01 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -687,370.06 | -1,147,631.61 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,968,344.68 | 1,457,914,794.65 |
| 2.基金赎回款 | 2,625,714.74 | 2,605,546.39 |
| 四、本期基金份额持有人申购/赎回产生的基金净值变动数 | -6,648,293.38 | -6,512,125.01 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 535,935,153.34 | 314,965,530.28 |

(二) 长城货币市场基金半年度财务报表附注(2008年1月1日至2008年6月30日)

附注一重要会计政策
(1) 本半年度财务报表所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报表相一致。
(2) 主要税项:
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]111号《关于调整证券投资基金交易印花税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
本基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

附注二本报告期无重大会计差错的内容和更正金额
附注三关联方关系及交易

| 关联方名称 | 与本基金关系 | 发生的变化 |
|----------------|---|-------|
| 长城基金管理有限公司 | 本基金管理人及发起人,本基金管理人主要股东的机构,本基金注册与登记机构,本基金销售机构 | 无 |
| 华夏银行股份有限公司 | 本基金管理人,本基金管理人主要股东的机构 | 无 |
| 长城证券股份有限公司 | 本基金管理人的主要股东,租赁交易席位,本基金销售机构 | 无 |
| 东方证券股份有限公司 | 本基金管理人的股东,本基金销售机构 | 无 |
| 中原信托投资有限公司 | 本基金管理人的股东 | 无 |
| 北方国际信托投资股份有限公司 | 本基金管理人的股东 | 无 |
| 德诚长城基金管理有限公司 | 本基金管理人主要股东的控股机构 | 无 |

2. 关联方交易:
(1) 本基金通过关联方席位进行的交易
本基金本期无通过关联方席位进行的交易。
(2) 本基金应支付的关联方报酬

| 关联方名称 | 本期数(元) | 上年同期数(元) | 计算标准 | 计算方式 |
|------------|------------|--------------|----------|--------------------|
| 长城基金管理有限公司 | 802,872.02 | 1,004,332.74 | 年费率0.33% | 按前一日基金资产净值乘以费率每日计提 |
| 合计 | 802,872.02 | 1,004,332.74 | -- | -- |

| 关联方名称 | 本期数(元) | 上年同期数(元) | 计算标准 | 计算方式 |
|------------|------------|------------|----------|--------------------|
| 华夏银行股份有限公司 | 243,294.72 | 304,343.24 | 年费率0.10% | 按前一日基金资产净值乘以费率每日计提 |
| 合计 | 243,294.72 | 304,343.24 | -- | -- |

| 关联方名称 | 本期数(元) | 上年同期数(元) |
|---------------------|------------|------------|
| 长城基金管理有限公司(本基金管理人) | 163,414.17 | 516,452.06 |
| 华夏银行股份有限公司(托管人) | 60,127.41 | 100,086.42 |
| 长城证券有限责任公司(基金管理人股东) | 10,379.14 | 9,026.36 |
| 东方证券股份有限公司(基金管理人股东) | 3,045.21 | 1,369.61 |
| 合计 | 236,965.93 | 726,934.45 |

| 关联方名称 | 本期数(元) | 上年同期数(元) |
|---------------------|------------|------------|
| 长城基金管理有限公司(本基金管理人) | 163,414.17 | 516,452.06 |
| 华夏银行股份有限公司(托管人) | 60,127.41 | 100,086.42 |
| 长城证券有限责任公司(基金管理人股东) | 10,379.14 | 9,026.36 |
| 东方证券股份有限公司(基金管理人股东) | 3,045.21 | 1,369.61 |
| 合计 | 236,965.93 | 726,934.45 |

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金在本报告期内,未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

(4) 各关联方投资本基金的情况
A. 本基金管理人本期投资本基金的情况
本基金管理人本期及上期均未投资本基金。期末也未持有本基金份额。
B. 本基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况
本基金管理人主要股东及其控制的其它机构本期未持有本基金。

(5) 关联方保管的银行存款余额
关联方名称 项目 2008年6月30日 2007年6月30日
华夏银行股份有限公司 银行存款 7,969,490.89 81,068,523.26

(6) 从关联方取得的利息收入
关联方名称 项目 本期数(元) 上年同期数(元)
华夏银行股份有限公司 存款利息收入 360,172.00 1,130,776.47

(7) 关联方往来款项余额
往来自名称 关联方名称 经济内容 2008年6月30日 2007年6月30日
应付管理人报酬 长城基金管理有限公司 管理费 104,678.97 369,123.56
应付销售服务费 华夏银行股份有限公司 托管费 31,720.28 104,343.24
其他应付关联方 长城证券有限责任公司 代垫的交易所保证金 250,000.00 250,000.00
其他应付关联方 华夏银行股份有限公司 银行间拆借 2,822.03 1,419.98
应付销售服务费 长城基金管理有限公司 销售服务费 16,911.45 3,069.94
应付销售服务费 华夏银行股份有限公司 销售服务费 10,273.58 0.00
应付销售服务费 长城证券有限责任公司 销售服务费 3,297.60 0.00
应付销售服务费 东方证券股份有限公司 销售服务费 69.00 0.00
应收利息 华夏银行股份有限公司 存款利息 6,727.29 32,206.31

附注四流通受限不能自由转让的基金资产
截止2008年6月30日,基金无从银行间同业市场债券正回购交易或证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款,亦无其他原因导致本报告期末基金资产流通受限的情况。

第七节 投资组合报告
(一) 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|------------------|----------------|----------------|--------------|
| 1 | 固定收益类投资 | 444,756,604.30 | 82.44 |
| 其中:债券 | 444,756,604.30 | 82.44 | |
| 资产支持证券 | -- | 0.00 | |
| 2 | 买入返售金融资产 | 49,400,164.10 | 9.16 |
| 其中:买入返售的买入返售金融资产 | -- | 0.00 | |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 9,339,561.14 | 1.73 |
| 4 | 其他资产 | 36,065,066.67 | 6.67 |
| 5 | 合计 | 539,501,425.21 | 100.00 |

(二) 报告期末债券回购融资情况
序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 4,214,733,091.62 5.94
其中:逆回购融资余额 0.00 0.00
2 报告期末债券回购融资余额 0.00 0.00
其中:逆回购融资余额 0.00 0.00

(三) 基金投资组合平均剩余期限
1. 根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字[2005]41号),自2006年4月1日起,除发生巨额赎回的情形外,货币市场基金投资组合中,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%。因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个工作日内进行调整。

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况具体如下表:

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值的比例(%) | 原因 | 调整期 |
|----|-----------|-------------------|------|-------|
| 1 | 2008-1-10 | 20.67 | 持续赎回 | 一个交易日 |
| 2 | 2008-4-29 | 21.47 | 持续赎回 | -- |
| 3 | 2008-4-30 | 21.54 | 持续赎回 | -- |
| 4 | 2008-5-1 | 21.54 | 持续赎回 | -- |
| 5 | 2008-5-2 | 21.54 | 持续赎回 | 三个交易日 |
| 6 | 2008-5-3 | 21.54 | 持续赎回 | -- |
| 7 | 2008-5-4 | 21.53 | 持续赎回 | -- |
| 8 | 2008-5-5 | 21.67 | 持续赎回 | -- |

2. 本基金本报告期内未有买断式回购融资业务发生。
(三) 基金投资组合平均剩余期限
1. 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|-----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限 | 128 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 169 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 7 |

注:根据《货币市场基金管理暂行规定》(证监发[2004]78号)和《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字[2005]41号),货币市场基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天。本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生过超过180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 | 报告期内投资组合平均剩余期限分布比例(%) | 报告期内投资组合平均剩余期限分布比例(%) |
|----|--------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1 | 30天以内 | 40.97 | 0.00 |
| 1 | 30天以内-持续超过397天的浮动利率债 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 30天-60天 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | 60天-90天 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 90天-180天 | 3.89 | 0.00 |
| 4 | 90天-180天-持续超过397天的浮动利率债 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 40.09 | 0.00 |
| 5 | 180天(含)-397天(含)-持续超过397天的浮动利率债 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | -- | 93.99 | -- |

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
1. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|--------|----------|-----------|----------------|-------|
| 1 | 070213 | 07国债13 | 1,600,000 | 160,022,580.84 | 29.96 |
| 2 | 080134 | 08央行票据34 | 1,300,000 | 126,277,621.96 | 23.86 |
| 3 | 070411 | 07央行发11 | 500,000 | 50,661,262.08 | 9.34 |
| 4 | 080031 | 08央行发31 | 500,000 | 48,610,714.54 | 9.07 |
| 5 | 080410 | | | | |