

农银汇理货币市场证券投资 基金招募说明书 2014年第1号更新 摘要

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
重要提示
 本基金的募集申请经中国证监会2010年10月8日证监许可【2010】[1359]号文核准。本基金的基金合同于2010年11月23日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会基金部备案(以下简称“中国证监会”)核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。
 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有份额享受基金收益,但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,某一基金的特定风险等。本基金为货币市场基金,属证券投资基金中低风险、低收益的品种,投资者购买本货币市场证券投资基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者有认购(申购)基金时应认真阅读读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
 本基金托管人已经对本招募说明书中涉及与托管业务相关的更新信息进行了复核、审查。招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年5月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)公司概况
 名称:农银汇理基金管理有限公司
 住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
 法定代表人:刁义斌
 成立日期:2008年3月18日
 批准设立机关:中国证券监督管理委员会
 批准设立文号:证监许可【2008】307号
 组织形式:有限责任公司
 注册资本:贰亿元人民币
 存续期限:永久存续
 联系人:崔爱东
 联系电话:021-61096588
 股权结构:

股东	出资额(元)	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理有限公司	66,666,667	33.33%
中国建设银行股份有限公司	30,000,000	15%
合 计	200,000,001	100%

(二)主要人员情况

1.董事会成员:
 刁义斌先生:董事长
 1976年起从事金融工作,具有三十余年金融从业经验。1980年起历任中国农银银行山东省龙口市支行行长、山东省分行副负责人及副行长、青岛分行行长、山东省分行行长。2010年起历任中国农银银行资产管理部总经理、总行运营管理部总经理,现任中国农银银行投资总监。2012年8月起兼任农银汇理基金管理有限公司董事长。
 Bernard Carayon先生:副董事长
 经济学博士。1978年起历任法国农业信贷银行集团督察员、中央风险控制部主管,东方汇理银行和东方汇理投资银行风险控制部部门主管,东方汇理资产管理公司管理委员会成员。现任东方汇理资产管理公司副总裁。

陈晓明先生:董事
 高级经济师。陈先生1980年开始进入中国农业银行浙江省分行工作,历任中国农业银行浙江省分行办公室主任、副行长。1999年12月至2006年11月在中国农业银行宁波市分行任行长。2006年11月至2009年10月在中国农业银行浙江分行任副行长,2009年10月至2014年3月在中国农银银行福建省分行任行长。2014年3月起任农银汇理基金管理有限公司副总监。

Thierry McQuillet先生:董事
 工商管理硕士。1979年开始从事银行工作,在Credit Agricole Indosuez 工作15年后并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司,历任香港区总经理。1990年起至今任东方汇理资产管理香港有限公司亚太区行政总裁。

刘文明先生:董事
 经济学博士、高级会计师、中国注册会计师。历任中国有色金属对外工程公司财务处处长,中国有色金属建设集团公司董事、副总经理,中国铝业公司副总经理。现任中国铝业股份有限公司执行董事、高级副总裁、财务总监、执行委员会委员。

华若鸣女士:董事
 先后工商管理硕士,高级经济师。1989年起在中国农业银行总行工作,历任中国农业银行总行国际业务部副总经理、香港分行总经理、总行电子银行部副总经理。现任中国农业银行股份有限公司金融市场部总经理兼资金交易中心总经理、外汇交易中心总经理。

王小先生:独立董事
 经济学博士。曾任盐城城市大学助理教授,世界银行顾问,联合国顾问、韩国首尔国立大学客座教授。现任复旦大学管理学院财务金融系教授,兼任香港大学商学院名誉教授和挪威管理学院兼职教授。

傅继军先生:独立董事
 经济学博士,高级经济师。傅继军先生1973年开始工作,曾任江苏省盐业汽车运输公司教师,江苏省人民政府研究中心主任,1990年3月起任中华财务咨询公司总经理。

徐信忠先生:独立董事
 金融学博士、教授。曾任英国Bank of England货币政策与金融经济学家,英国兰卡斯特大学管理学院金融学教授;北京大学光华管理学院副院长、金融学教授。现任中山大学岭南(大学)学院院长、金融学教授。

2.公司监事
 陈方华先生:监事会主席
 工商管理硕士。1980年起历任中国农业银行浙江省温州市支行行长、分行行长、厦门分行行长。2009年7月至2012年6月在中国农业银行信贷中心任总经理。2012年7月起担任农银汇理基金管理有限公司监事会主席。

Jean-Yves Glin先生:监事
 硕士。1996年加入东方汇理资产管理公司,历任销售部负责人、市场部负责人、国际事务协调和销售部副负责人。现任东方汇理资产管理公司国际协调与销售部负责人。

欧小武先生:监事
 1985年起在中国有色金属工业总公司、中国铜铅锌集团公司工作。2000年起历任中国铝业公司和中国铝业股份有限公司、财务部(审计部)主任、财务部副总经理。2001年至2006年任中国铝业股份有限公司监事。现任中国铝业公司审计部主任、中国铝业股份有限公司审计部总经理。

叶光尧先生:监事
 经济学硕士。2000年起先后就职于中国工商银行深圳分行、万家乡基金管理有限公司。2008年加入农银汇理基金管理有限公司,现任农银汇理基金管理有限公司销售副部副总经理。

穆晓女士:监事
 管理学学士。2008年加入农银汇理基金管理有限公司,现任综合管理、人力资源部负责人。

3.公司高级管理人员
 刁义斌先生:董事长
 1976年起从事金融工作,具有三十余年金融从业经验。1980年起历任中国农业银行山东省龙口市支行行长、山东省分行副负责人及副行长、青岛分行行长、山东省分行行长。2010年起历任中国农业银行资产管理部总经理、总行运营管理部总经理,现任中国农银银行投资总监。2012年8月起兼任农银汇理基金管理有限公司董事长。

施卫先生:副总经理
 经济学硕士、金融理学硕士。1992年7月起任中国农业银行上海市浦东分行国际部副经理、办公室主任、行长助理,2002年7月起任中国农业银行上海市分行公司业务部副总经理,2004年3月起任中国农业银行香港分行副总经理,2008年4月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监,2010年10月起任中国农业银行东京分行筹备组组长,2012年12月起担任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监。2014年3月4日起担任农银汇理基金管理有限公司总经理助理。

Laurent Tournier先生:副总经理
 管理学硕士。1987年至2000年担任摩根大通银行欧洲清算系统公司北亚地区公关经理、北亚地区销售和公关经理、副总裁。2000年加入法国农业信贷银行集团,历任东方汇理银行(香港)项目主管、东方汇理银行(巴黎)托管部业务发展总监、东方汇理资产管理公司运营总监。2009年8月起担任农银汇理基金管理有限公司副总经理、运营总监。

崔爱东先生:督察长
 高级工商管理硕士。具有20余年金融从业经验。1988年起先后在中国人民银行(中国金融杂志社)、国际部、伦敦代表处、个人业务部、信用卡中心工作。2004年11月起参加农银汇理基金管理有限公司筹备工作。2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书,监察稽核部总经理,2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

4.基金经理
 吴先生,CFA,财政学硕士。具有7年证券业从业经历。曾担任兴业银行基金营销中心公司债券交易员和账户经理,现任农银汇理货币市场基金基金经理。农银汇理货币市场基金基金经理。

6.投资决策委员会
 本基金采取集体投资决策制度。
 投资决策委员会由下述委员组成:
 投资决策委员会主席施卫先生,现任农银汇理基金管理有限公司副总经理,2014年3月4日起代为履行农银汇理基金管理有限公司总经理职务;

投资决策委员会成员Denis Zhang(张惟)先生,公司投资副总监;
 投资决策委员会成员李雨南先生,投资部副经理,农银汇理大盘蓝筹股票型基金基金经理;
 投资决策委员会成员方向明女士,投资部副经理,农银汇理恒久增利债券型基金基金经理;农银汇理增利收益债券型基金基金经理;农银汇理7天理财债券型基金基金经理;

投资决策委员会成员付娟女士,研究部副总经理,农银汇理消费主题股票型证券投资基金基金经理;农银汇理中盘股票型证券投资基金基金经理。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

(一)基金托管人基本情况
 名称:中国工商银行股份有限公司
 注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
 成立时间:1984年1月1日
 法定代表人:姜建清
 注册资本:人民币349,018,548,827元
 联系电话:010-66105799
 联系人:赵会军

(二)主要人员情况
 截至2014年3月末,中国工商银行托管资产托管共有员工176人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况
 作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首

家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中丰富、成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资产、企业年金基金、QDII资产、ODLI资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金产品特定客户资产管理、ODLI专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2014年3月,中国工商银行共托管证券投资基金372只。自2003 年以来,本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内权威财经媒体评选的41项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
 1.直销机构:
 名称:农银汇理基金管理有限公司
 住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7楼
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7楼
 法定代表人:刁义斌
 联系人:沈婧
 客户服务热线:4006895699
 联系电话:021-61096510
 网址:www.abc-cm.com
 2.代销机构:
 (1)中国农业银行股份有限公司
 住所:北京市东城区建国门内大街69号
 办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
 法定代表人:蒋超良
 客服电话:95599
 网址:www.abchina.com
 (2)中国工商银行股份有限公司
 住所:北京市西城区复兴门内大街55号
 法定代表人:姜建清
 联系人:王均金
 客服电话:95588
 网址:www.icbc.com.cn
 (3)中国建设银行股份有限公司
 住所:北京市西城区金融大街25号
 办公地址:北京市西城区南滨河路1号1号楼
 法定代表人:王洪章
 联系人:张静
 联系电话:95533
 网址:www.ccb.com
 (4)交通银行股份有限公司
 住所:上海市银城中路188号
 办公地址:上海市银城中路188号
 法定代表人:牛锡铭
 联系人:曹程
 客服电话:95559
 网址:www.bankcomm.com
 (5)中信银行股份有限公司
 办公地址:北京市东城区朝内大街188号财富大厦C座
 法定代表人:常振明
 联系人:郭伟
 客服电话:95558
 网址:bankofchina.com
 (6)渤海银行股份有限公司
 住所:天津市河西区马场道201-205号
 办公地址:天津市河西区马场道201-205号
 法定代表人:刘宝凤
 联系人:王宏
 客服电话:400-888-8811
 网址:www.cbhb.com.cn
 (7)中国银行股份有限公司
 注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
 法定代表人:董晨
 联系人:董晨
 客服电话:95568
 网址:www.cmbc.com.cn
 (8)国泰君安证券股份有限公司
 注册地址:上海市浦东新区银城中路618号
 办公地址:上海市浦东新区银城中路618号
 法定代表人:万建华
 联系人:芮筱婷
 电话:021-38676666
 传真:021-38670666
 客服电话:4008888666
 网址:www.gtja.com
 (9)中信建投证券股份有限公司
 注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
 办公地址:北京市朝阳门内大街188号
 法定代表人:王常青
 联系人:权恒
 传真:010-65618261
 客服电话:4008881108
 网址:www.csc108.com
 (10)广发证券股份有限公司
 注册地址:广州天河区天河路183-187号大都会广场43楼(4301-4313房)
 办公地址:广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
 法定代表人:孙树树
 联系人:黄真
 客服电话:95575或致电各地营业网点
 网址:www.gf.com.cn
 (11)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号国际企业大厦C座
 法定代表人:陈共炎
 联系人:田薇
 客服电话:400-8888-888
 电话:010-66569430
 网址:www.chinastock.com.cn
 (12)海通证券股份有限公司
 注册地址:上海市淮海中路90号
 办公地址:上海市广东路689号
 法定代表人:王开国
 联系人:金芸、李美蓉
 客服电话:021-68799999
 电话:027-86481900
 客服电话:95579或4008-888-999
 网址:www.95579.com
 (15)华泰证券股份有限公司
 地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
 法定代表人:吴万善
 联系人:孔晓
 电话:025-84457777
 传真:025-84579768
 客服电话:95597
 网址:www.htsc.com.cn
 (16)中信万通证券有限责任公司
 注册地址:青岛市市南区香港路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层

法定代表人:马强
 联系人:吴忠超
 电话:0532-85022326
 传真:0532-85022805
 客服电话:95548
 网址:www.zxwt.com.cn
 (17)东方证券股份有限公司
 注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
 办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
 法定代表人:潘鑫军
 联系人:吴宇
 联系电话:021-63256888
 客服电话:95503
 网址:www.dfzq.com.cn
 (18)光大证券股份有限公司
 办公地址:上海市静安区新闸路1508号
 法定代表人:袁长清
 联系人:刘晨、李芳芳
 联系电话:021-22169999
 传真:021-22169134
 客服电话:400888788、10108938
 网址:www.ebscn.com
 (19)安信证券股份有限公司
 注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
 深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋楼层
 法定代表人:牛冠斌
 联系人:陈剑虹
 联系电话:0755-82825561
 客服电话:4008010001
 网址:www.essence.com.cn
 (20)上海好又美金融销售有限公司
 注册地址:上海市虹口区四川路685弄37号4号楼440室
 办公地址:上海市浦东新区南118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
 法定代表人:杨文斌

电话:021-58870011
 传真:021-68596919
 客服电话:400-700-9665
 网址:www.eshowbuy.com
 (21)杭州数米基金销售有限公司
 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
 法定代表人:陈柏青
 电话:0571-28827900,021-60897869
 传真:0571-26898533
 客服电话:4000-766-123
 网址:www.fund123.cn
 (22)上海天天基金销售有限公司
 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
 法定代表人:其实
 电话:021-64509888
 传真:021-64508878
 客服电话:4000-1818-188
 网址:www.1234567.com.cn
 (23)深圳众禄基金销售有限公司
 办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、L单元
 法定代表人:薛峰
 电话:0755-33227950
 客服电话:4006-788-887
 网址:www.zlfund.com
 (24)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
 注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006H
 法定代表人:陈操
 联系人:刘文文
 电话:010-58326395
 客服电话:400-850-7771
 网址:tjq.com
 (25)其它代销机构
 其它代销机构名称及其信息另行公告。

(二)注册登记机构
 农银汇理基金管理有限公司
 住所:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7楼
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7楼
 法定代表人:刁义斌
 电话:021-61095688
 传真:021-61095666
 联系人:高利民
 客户服务热线:021-61095699
 (三)出具法律意见书的律师事务所
 名称:上海源泰律师事务所
 住所:上海市浦东新区世纪大道1405室
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1405室
 负责人:廖海
 联系电话:021 51150298
 传真:021 51150398
 联系人:廖海
 经办律师:廖海、刘佳
 (四)审计基金财产的会计师事务所
 名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼
 办公地址:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
 法定代表人:杨绍信
 联系电话:021 23238888
 传真:(021) 23238800
 联系人:沈兆杰
 经办注册会计师:薛竞、张敬芝

农银汇理货币市场证券投资基金

基金的投资目标
 本基金以保持资产的低风险和流动性为优先目标,力争实现超越业绩比较基准的投资回报,为投资者提供良好的现金管理工具。

基金的投资范围
 本基金主要投资于货币市场金融工具:
 现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限在397 天以内(含397 天)的债券,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,期限在一年以内(含一年)的债券回购,短期融资券,剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规和中国证监会允许货币市场基金投资于其它品种,基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入到基金的投资范围。

基金的投资策略
 对于利率策略,本基金将首先考虑安全性因素,优先选择央票、短期融资券等高信用等级的债券品种以回笼资金。对于外部信用评级较低的等级较高(AAA以下),并进入中国信用评级核心库的企业债、公司债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行投资。除考虑安全性因素外,在具体品种的选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率出现明显偏离的品种,并客观分析收益率出现偏离的原因,若出现因市场原因所导致的收益率高于公允价值,则该品种价格出现低估,本基金将对此类低估值品种进行重点关注。此外,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。

4. 套利策略
 本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下,综合平衡基金资产在流动性和收益性之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性品种、正回购回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。同时,基金管理人将密切关注投资者大额申购和赎回的需求变化,根据投资者的流动性需求提前做好资金准备。

九、基金的业绩比较基准
 同期七天通知存款利率(税后)

十、基金的风险收益特征
 本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

十一、基金的投资组合报告
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同约定,于2014年6月13日复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容。

本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。

1.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	固定收益投资	2,375,338,919.49	21.81
	其中:债券	2,375,338,919.49	21.81
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	8,118,180,401.57	74.54
4	其他资产	397,657,580.52	3.65
5	合计	10,891,177,301.58	100.00

2.报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.35
	其中:买断式回购融资	0.00

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1,829,414,935.87	20.23
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

注:报告期内债券回购融资余额中逆回购融资余额

每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2014年3月31日	20.23	巨额赎回	2个交易日

3、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
报告期末投资组合平均剩余期限	157
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	158
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
 本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天,下同。因出现巨额赎回,在报告期内出现了基金投资组合的平均剩余期限超过120天的现象,基金管理人已在报告期内进行了调整。

(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	10.79	20.23
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
2	30天(含)-60天	8.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
3	60天(含)-90天	42.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	0.77	-
4	90天(含)-180天	12.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
5	180天(含)-397天(含)	41.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
合计		116.02	20.23

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	555,797,514.04	6.15
	其中:政策性金融债	555,797,514.04	6.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,819,541,405.45	20.12
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,375,338,919.49	26.26
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	69,886,361.44	0.77

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

2	央行票据			
3	金融债券	555,797,514.04	6.15	
	其中:政策性金融债	555,797,514.04	6.15	
4	企业债券	-	-	
5	企业短期融资券	1,810,844,405.45	20.43	