

建信双月安心理财债券型证券投资基金招募说明书(更新摘要)

基金管理人:建信基金管理有限责任公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

二〇一六年三月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2012年11月19日证监许可[2012]1541号文核准募集。本基金合同已于2013年1月29日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和本基金招募说明书编制,并经中国证监会核准,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财产,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,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各种风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素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、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人从证券价格产生波动而形成的系统性风险。本基金的特有风险,等等。本基金是债券型基金,风险低于股票型基金、混合型基金、高干货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目标、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

投资者在认购、申购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2016年1月28日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
成立时间:2006年9月19日
法定代表人:许会斌
联系人:郭雅莉
电话:010-66228888
注册资本:人民币2亿元
建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2006]158号文批准设立。公司的股权结构如下:

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国华安金融服务公司	25%
中国华电集团资本控股有限公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确规定了股东依法行使权利,不以任何形式直接或间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司决策机构,对股东会负责,并由股东会授权。公司董事会由9名董事组成,其中3名为外部董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定和对总裁等高级管理人员的监督和任免权。

公司设监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员履职尽责情况。

(二)主要人员情况

1.董事成员

许会斌先生,董事长。自2013年3月起至现在,出任中国建设银行批发业务总经理;自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长;自1994年6月至2006年6月历任中国建设银行河南清镇营业部副主任,零售业务部副总经理,个人银行部副总经理,零售部主要负责人、总经理,个人银行业务部总经理,个人银行业务委员会副主任,个人金融部总经理,许先生是高级经理,并是国务院特聘津贴获得者,曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。1983年于辽宁财经学院建财财务与信贷专业大学本科毕业。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生,董事。1986年毕业于东北财经大学会计学学士学位,2006年获长江商学院EMBA。历任中国建设银行筹资资产部副总经理,中国建设银行筹资部,零售业务部,香港赛马会副集团董事,信安银行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生,董事。现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄部、零售部副总经理,北京分行安华支行副行长,北京分行西四支行副行长,北京分行朝阳支行行长,北京分行个人银行部总经理,中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生,董事。现任信安国际(亚洲)副总裁。1980年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获哈佛大学商学院和复旦大学EMBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共服务有限公司副社长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,诚信基金公司首席运营官和代总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事。

袁时彦先生,董事。现任信安国际有限公司大中华区首席运营官。1981年毕业于美国阿拉巴马大学。历任香港汇丰银行银行部副经理,加拿大丰业银行资本市场部副经理,香港铁路公司库务部助理司库,香港置地集团库务部董事,香港赛马会副集团董事,信安银行有限公司大中华区首席运营官。

殷红军先生,董事。现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济专业,获硕士学位。历任中国电力财务有限公司融资租赁部项目经理,华电集团资产管理有限公司投资咨询部副经理(主持工作)、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

李全先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1988年毕业于中国人民大学经济学院,获经济学学士学位。历任中国工商银行总行资产管理部职员,正大国际财务有限公司总经理助理/资产部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生,独立董事,曾任中国人寿保险有限公司首席执行官,中银保险退休信贷管理部副总经理,美国华安保险有限公司首席行政官,美国国际保险集团亚太区资深副总裁,美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政官等。1989年获Pacific Southern University民权管理硕士学位。

伏军先生,独立董事,法学博士,现任对外经济贸易大学法学院教授,兼任中国法学会国际经济法研究会常务理事,副秘书长,中国国际金融法学会副会长。

2.监事会成员

王雪玲女士,监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理专业工商管理专业,高级经理职务。历任中国建设银行山东省分行计划处职员、中国建设银行新疆维吾尔自治区计划处、信贷处、风险处和人力部等副处长、处长、行长助理、副行长,中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。

方晋敏女士,监事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席行政官。曾任英国保诚集团新市场发展总监和国际集团全球业务及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获加拿大国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限公司机构与风险管理部副经理。1992年获北京工业大学会计专业学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京奥美有限公司,中进会计师事务所,中瑞华信会计师事务所,中国华电集团资产管理有限公司计划财务部助理经理、副经理,中国华电集团资本控股(华电财务公司)计划财务部副经理,中国华电集团财务有限公司财务经理,中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

吴昊女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部管理部总经理兼综合管理部副经理。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系,获得学士学位;2001年毕业于北京师范大学经济系,获得管理学硕士学位。历任中国建设银行总行人力资源部主任科员,高级经理助理,建信基金管理公司人力资源部总监助理、副总监、总监。

安晖先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机专业应用专业,获得学士学位。同知加入中国建设银行,历任中国建设银行北京分行科技部科员,中国建设银行信息技术管理部主任科员、项目经理,建信基金管理公司基金运营部副经理、副总监,信息技术部执行总监、总监。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副经理,英国特许公认会计师公会(ACCA)资深会员,1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师,华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理,2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

3.公司高管人员

孙志晨先生,总裁(简历请参见董事会成员)。
张威先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券投资基金销售业务,任副处长;2005年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任我司副总裁。

曲寅军先生,副总裁,硕士。1994年7月加入中国建设银行总行,历任信贷部科员、副主任科员、团委主任科员,重组改制办副主任高级副经理(副处长)、行政办公室高级副经理(副处长);2006年6月起调任建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官;2013年8月至今,在我公司控股子公司建信资本管理有限公司任董事、总经理。2015年8月6日起任我司副总裁。

4.督察长

吴耀明先生,督察长。1992年毕业于中国工业大学管理系,获学士学位,1999年毕业于财政政法研究所获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1996年7月加入中国建设银行,先后任总行营业部、金融管理部、机构业务部从事信贷业务和证券业务;历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理(副处长)等职;2006年5月加入我公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部总监。2015年8月6日起任我司督察长。

5.本基金基金经理

高蕾女士,硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员;2007年6月加入我公司工作,历任初级交易员、交易员、基金经理助理;2012年8月28日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金

基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理,2015年8月25日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

6.投资决策委员会成员

孙志晨先生,总裁。
梁洪钧先生,金融工程及指数投资部总经理。
钟敏刚先生,固定收益投资部首席固定收益投资官。
李青,固定收益投资部副总经理。
姚婉女士,权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。
顾中汉先生,权益投资部副总经理。
许杰先生,权益投资部基金经理。
7.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

1.基本情况
名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755-83190084
传真:0755-83190201
资产托管部信息披露负责人:张燕

2.发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿美元,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿美元,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3068),10月6日行使H股超额配售,共发行了24.24亿股。截止,2015年9月30日,本集团总资产5,223.27亿元人民币,高级法下资本充足率12.79%,权重法下资本充足率12.24%。

2002年6月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理、产品管理、业务运营、稽核监察、基金外包业务室5个职能处室,现有员工60人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式受理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先声夺人”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值观,独创“SST托管银行”品牌体系,以“保护投资者的财产、您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品,在业内率先推出“网上托管银行系统”,托管业务综合系统和“6C”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商基金资产,第一只封闭式基金,第一只信托资产计划,第一只股权投资基金,第一只实物证券基金,第一只“1+N”基金专户理财,第一家大小非解禁资产,第一只TOT信托资产,实现从单一托管服务向全面托管服务及托管业务的转变,得到了同业认可。

经过十三年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2015年招商银行加大高收益托管产品营销力度,截止12月末新增托管公募开放式基金61只,新增首发公募封闭式基金托管规模900.05亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势,托管费收入、托管资产均创出历史新高,受托托管费收入35.66亿元,同比增长68.93%,托管资产余额1.16万亿元,同比增长101.97%。作为公益慈善基金的个人独立第三方托管资产,成功荣获“壹基金”公益慈善托管奖,为我国公益慈善基金监管、信息披露行业有极高荣誉,该项目荣获2012年中国金融品牌“金壹奖”“十大公益项目”奖;四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

(二)主要人员情况

李建红先生,本行董事长,非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。美国俄亥俄大学工商管理硕士、吉林大学经济管理学院主任,高级经济师。招商银行集团首席董事,兼任招商银行国际有限公司董事兼主席,招商局集团运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长,执行董事,2013年5月起担任本行行长,兼任总行董事。美国哥伦比亚大学工商管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年6月历任上海银行副行长,中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生,本行副行长,大学本科毕业,副研究员。1996年12月加入本行,历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理,杭州分行副行长,副行长,南昌支行行长,南昌分行行长,总行人力资源部总经理,总行行长助理,2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农村银行黑龙江分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业上从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的丰富和扎实的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况

截至2016年1月31日,招商银行股份有限公司累计托管154只开放式基金及其它托管资产,托管资产为72,766.94亿元人民币。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。
(1)直销柜台
名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人:许会斌
联系人:郭雅莉
电话:010-66228800
(2)网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务,具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址:www.cbfund.com。

2.代销机构

(1)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:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)
法定代表人:王洪章
客服电话:95533
网址:www.ccb.com
(2)招商银行股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com
(3)深圳弘基基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼A1单元
法定代表人:薛峰
客户服务电话:4006788887
网址:www.zhfund.com、www.jimwmw.com
(4)杭州凯基基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3688号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:400766123
网址:www.fund123.cn
(5)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区四川中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:张斌
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.howbuy.com

(6)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙阳路190号2号楼2层
法定代表人:其实
客户服务电话:4001818188
网址:www.1234567.com.cn
(7)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客户服务电话:4009200022
(8)浙江网际顺基基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人:史斌
客户服务电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com

(9)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
法定代表人:张磊
客户服务电话:400-820-2819
网址:www.chinapnr.com
(10)中国银联股份有限公司
注册地址:中国北京建国门外大街1号国贸写字楼2座28层1邮编:100004
法定代表人:李相建
客户服务电话:(+86-10) 6505 1166
网址:http://www.citcc.com/index_cn.shtml
(11)中国期货有限公司
地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层
1301-1305、14层
法定代表人:张浩
客服电话:400 9908 826
网址:http://www.citcf.com
(12)招商证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客户服务热线:95565,4008888111
网址:www.newone.com.cn

2016年第1号

(13)北京晟视天下投资管理股份有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄庄村735号03室
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:4008188866
网址:www.shengshiview.com
(14)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
法定代表人:梁越
客户服务电话:4007868868
网址:www.chtfund.com
(15)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
法定代表人:张磊
客户服务电话:400-820-2819
网址:www.chinapnr.com
(16)北京微众利投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号财富中心341
法定代表人:梁爽
客户服务电话:400-819-6666
网址:htp://www.buylife.com.cn
基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构
名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
电话:0755-83190084
法定代表人:许会斌
联系人:郭雅莉
电话:010-66228888
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:北京德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人:王丽
联系人:徐建琴
电话:010-66575888
传真:010-66232181
经办律师:徐建琴、刘婉志

2. 报告期末债券回购融资情况
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
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
执行事务合伙人:李丹
联系人:陈磊
联系电话:021-22323888
传真:021-22323800
经办注册会计师:薛竟、陈磊

四、基金的名称

建信双月安心理财债券型证券投资基金。

五、基金的类型

债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括:现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款及银行协议存款,剩余期限一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中长期银行票据,中期票据,短期融资券,剩余期限397天以内(含397天)债券(不含可转换债券),以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。

八、基金的投资策略

在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。

(一)投资策略
本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险条件下的投资收益。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。

1. 资产配置策略
本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时期内不同投资品种的相对预期收益,在基金规定的投资比例范围内对不同投资品种与现金之间进行动态调整。

2. 债券投资组合策略
本基金在综合分析宏观经济、货币政策的基础上,综合运用久期管理策略、期限配置策略、类属配置策略、套利策略等组合管理手段进行日常管理。

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	9.21	16.77
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
2	30天至<60天	33.20	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
3	60天至<90天	28.53	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
4	90天至<180天	30.14	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
5	180天至<397天	15.01	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
合计	116.69	16.77	-

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	40,029,056.25	6.04
其中:政策性金融债	40,029,056.25	6.04	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	220,080,415.08	33.21
6	中期票据	-	-
7	同业资产	188,150,858.85	28.39
8	合计	448,260,330.18	67.65
9	其他	-	-
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
合计	116.69	16.77	

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

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	111591862	15宁波银行CD106	500,000	49,601,923.07	7.49
2	111509225	15国债CD225	400,000	39,660,170.84	5.99
3	111515134	15中信CD134	400,000	39,596,734.67	5.98
4	011599600	15国债CD106	300,000	30,069,863.67	4.54
5	011509262	15国债CD202	300,000	29,968,249.53	4.53
6	011509167	15国债CD300	300,000	29,994,964.88	4.53
7	011517167	15光大CD167	300,000	29,775,564.53	4.49
8	111503389	15浦发CD181	300,000	29,516,466.74	4.45
9	011508009	15国债CD309	200,000	20,026,613.95	3.02
10	150301	15渣打01	200,000	20,013,570.71	3.02
6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	-	-	-	-

在市场价格或无效状况下,本基金将根据市场实际情况,积极运用各类套利策略对资产投资组合进行管理,捕捉交易机会,以获取超额收益。

1) 回购套利
本基金将适时运用多种回购交易套利策略以增强静态组合的收益,并适时运用回购与融券的套利,不同回购期限之间的套利等策略进行相对低风险套利操作,从而获得杠杆放大收益。

2) 跨市场套利
本基金利用同一只债券类投资工具在不同市场(主要是银行间市场和交易所市场)的交易价格差异进行套利,从而提高债券投资组合的投资收益。

3) 券息策略
在个券选择上,本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险定价、流动性分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对优势的个券。

(二) 投资决策体制和流程
1. 投资决策体制
本基金管理人建立了包括投资决策委员会、研究部、交易部等部门的完整投资管理體系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构,根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度,确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则,确定基金的总体投资方案;负责基金资产的风险控制,审批重大投资决策;监督并考核基金经理、投资经理及基金投资顾问投资决策委员会的决策,构建投资组合,并负责组织实施、跟踪和评估,以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议,交易部根据基金经理的交易指令,进行基金资产的日常交易,对交易指令及时反馈。

2. 投资流程
(1) 研究分析
基金管理人研究和投资部门广泛参考和利用外部的研究成果,了解国家宏观经济和财政政策,对资金利率走势及债券发行人的信用风险进行监测,并建立相关研究模型。基金管理人研究部门撰写宏观策略报告、利率监测报告、债券发行人资信研究报告等,作为投资决策的重要依据。

(2) 投资决策
投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规以及公司有关规章制度确定基金的投资原则以及基金资产配置比例范围,审批总体投资方案以及重大投资决策。

基金经理根据投资决策委员会确定的对投资、投资结构、持仓比例范围等总体投资方案,并结合研究人员提供的投资建议,自己的研究与分析判断,以及基金申购赎回情况和市场整体情况,构建并优化投资组合。对于超出权限范围的投资,按照公司权限审批流程,提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

(3) 交易执行
交易部接受基金经理下达的交易指令。交易部接到指令后,首先对指令予以审核,然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或不合规的,交易部可以暂不执行,并即时通知基金经理或相关人员。

交易部根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况,并对该交易的判断和建议,以便基金经理及时调整交易策略。

(4) 投资回顾
绩效评估小组定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况,并提出下期的操作思路,作为投资决策

委员会决策的参考。

九、基金的业绩比较基准