

广发活期宝货币市场基金招募说明书 更新 摘要

[2016年第1号]

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
时间:二〇一六年四月

【重要提示】

本基金于2014年6月22日经中国证监会证监许可[2014]619号文注册。本基金合同于2014年8月28日生效。

本基金管理人保证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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。
基金管理人管理的其他基金业绩不构成对本基金业绩表现的保证。
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类风险,包括:因政治、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,基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等等。
本基金为货币市场基金,风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
投资者在作出投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年2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)。

第一部分 基金管理人

一、概况

1、名称:广发基金管理有限公司
2、住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
3、办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
4、法定代表人:王志伟
5、设立时间:2003年8月6日
6、电话:020-83936666
7、全国统一客服热线:95105828
8、联系人:段西军
9、注册资本:126882亿元人民币
10、股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”),烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司,分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1. 董事会成员

王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师,兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省政府决策咨询顾问委员会企业家协会委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广东省第十届政协委员,广发证券董事长兼党委书记,广东发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上市复核委员会委员。曾任广发证券投行总部北京业务部总经理,兼股权投资部总经理,上海业务部副总经理,投资银行部常务副总经理。

孙晓燕:董事,女,硕士,现任广发证券副总裁、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事,证通股份有限公司监事、监事长。曾任广发广发证券投资公司投资银行部经理,广发证券有限责任公司财务部经理,财务副经理,投资自营部副经理,广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俊:董事,男,管理学硕士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火烽火光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火滕光光纤科技有限公司、江苏烽火诚域科技有限公司、江苏烽视网有限公司、西安烽火光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都烽火线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事;兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息通信技术有限公司、滕光烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司董事。曾任烽火通信股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理。

董魏明:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人,香江集团有限公司总裁。兼任全国政协委员、全国妇联常委、香江社会救助基金会主席,深圳市深商控股集团股份有限公司董事,广东南粤银行董事,深圳龙岗国家村镇银行董事。

许冬瑾:董事,女,工商管理硕士,主管理师,现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理,兼任中国中药协会中药饮片专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会专家、全国中药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员、国家中医药行业特有工种和职业技能鉴定工作中药炮制与配剂工艺专业专业委员会副主任委员、广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。曾任广东康美药业股份有限公司副总经理。

董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海四维尔马律师事務所兼职律师,招行银行独立董事,海南生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系副主任,复旦大学法学院副院长。

姚海鑫:独立董事,男,经济学博士,教授、博士生导师,现任中山大学新华国际商学院教授,兼任东北制药(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院院长,工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记。

罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任中华联合保险控股股份有限公司常务副总裁,兼任中华联合财产保险股份有限公司总裁(法人代表)。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理,中国人民保险公司湖北省分公司业务处长,中国人民保险公司湖北省分公司总经理,中国人民保险公司汉口分公司总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险公司总经理助理,太平保险分公司副总经理兼纪委书记,民安保险(中国)有限公司副总裁,阳光财产保险股份有限公司副总裁,阳光保险集团执行委员会委员。

2. 监事会成员

余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理,广发证券基金部副总经理,聚实基金管理有限公司副总经理、董事长。

匡丽军:监事,女,工商管理硕士,高级涉外秘书,现任广州科技风险投资有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任,广州屈臣氏公司行政主管,广州市科达实业发展有限公司办公室主任、总经理,广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉:监事,男,工学硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分公司主席。曾任广发证券电脑中心员工、副经理、经理。

3. 总经理及其他高级管理人员
林传辉:总经理,男,大学本科学历,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上市复核委员会委员。曾任广发证券投行总部北京业务部总经理,兼股权投资部总经理,上海业务部副总经理,投资银行部常务副总经理,投资银行部常务副总经理。

朱平:副总经理,男,硕士,经济师,中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海联华集团市场部经理,广发证券投资银行部华南业务部副总经理,基金科汇基金管理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人,广发基金管理有限公司总经理助理。

郑翔方:副总经理,男,经济学硕士,经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发聚兴股票型证券投资基金基金经理,广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事,瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理,中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员,广发基金管理有限公司投资管理部总经理,广发基金管理有限公司总经理助理,广发制造业精选股票基金基金经理。

段西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

邱春华:副总经理,男,经济学博士,瑞元资本管理有限公司董事。曾任南方证券资产管理部产品设计人员,广发基金管理有限公司机构理财部副总经理,金融工程部副总经理、产品总监、金融工程部总经理。

4. 基金经理

魏芳:女,中国籍,经济学学士,15年证券和基金从业经历,持有中国证券投资基金从业证书,2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司广州营业部,2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部任职,2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作,2010年4月29日起担任“广发货币市场基金”经理,2013年1月14日起任广发理财30天债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年12月2日起任广发基金鑫宝内货币基金的基金经理,2014年3月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2014年8月28日起任“广发活期宝货币市场基金”的基金经理。

任爽,女,中国籍,经济学硕士,7年基金从业经历,持有中国证券投资基金从业证书,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员,2012年12月12日起任“广发纯债债券基金”的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年10月22日起任“广发天虹灵活配置货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任“广发天利货币市场基金的基金经理,2014年5月30日起任“广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任“广发活期宝货币市场基金的基金经理,2015年6月8日起任广发聚泰混合基金的基金经理。5、本基金投资决策采取集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平、公司副总经理易阳方,权益投资一部总经理刘晓松,研究发展部总经理孙涛,固定收益部总经理张平。

三、基金管理人职责

1. 依法募集资金、办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2. 办理基金备案手续;
3. 对所管理的不同基金财产分别管理,分别记账,进行证券投资;
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
6. 编制季度、半年度和年度基金报告;
7. 计算并公告基金资产净值,确定基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率;
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
9. 召集基金份额持有人大会;
10. 建立基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
11. 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1. 基金管理人承诺:
(1) 严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《基金法》及其他相关法律法规的行为发生;
(2) 根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资。

2. 基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定,基金资产不得用于下列投资或者活动:

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;
(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5) 法律法规及中国证监会规定禁止的其他行为。
3. 基金管理人承诺:
(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益;
(3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(4) 不协助、接受委托或以其他方式为其他组织或个人进行证券投资。

五、基金管理人的内部控制制度
基金管理人内部控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,对各项基本管理制度的总称和指导,内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织架构、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评价考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

六、基金管理人内部控制制度的主要原则
1. 建立以各岗位主体责任为基础的第一道内部控制。各岗位均有明确的岗位职责,各业务均制定详尽的操作流程,各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守,在授权范围内承担各自职责。

2. 建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道内部控制。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度,后续部门及岗位对前一部部门及岗位负有监督的责任。

3. 建立以监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道内部控制。监察稽核部属于内核部门,直接接受总经理的领导,独立于其他部门和业务活动,对内部控制制度的执行情况进行严格的检查和监督。

4. 建立以合规审核委员会及督察长为核心,对公司所有经营管理行为进行监督的第四道控制防线。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号
办公地址:上海市江宁路168号
法定代表人:高建平
成立日期:1988年8月22日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行总行,银复[1988]1347号
组织形式:股份有限公司
注册资本:190,523,675亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]74号
联系人:林成
联系电话:021-52629999-212012
传真:021-62192517
兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本190.52亿元。开业二十多年来,兴业银行始终秉持“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。根据2014年业绩快报,截至2014年12月31日,兴业银行资产总额达4.41万亿元,股东权益2450亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润471.08亿元。2014年兴业银行市场地位和品牌形象稳步提升,稳居全球银行50强(美国《银行家》杂志排名)、世界企业500强(美国《财富》杂志排名)和全球上市企业200强(美国《福布斯》杂志排名)行列。在国内外各种权威机构组织的评比中,先后荣获最佳中资银行、最佳战略合作银行、最佳绿色银行、最佳互联网金融平台银行、普华永道实践最佳银行、最具社会责任上市公司、中华慈善突出贡献(单位)奖、中国最佳雇主等荣誉。

二、基金托管部门及主要人员情况
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理组、期货存管核算处、养老金管理中心等处室,共有员工197人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、证券投资基金托管情况
2005年4月26日,经中国证监会和中国银监会核准,兴业银行获得开展证券投资基金托管业务资格。截止2015年12月31日,兴业银行已托管开放式基金73只,托管基金财产规模2883.18亿元。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1. 直销机构
本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金开户、认购等业务:
(1) 广州分公司
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场南塔17楼
直销中心电话:020-89899073 020-89899074
020-89899069 020-89899070
(2) 北京分公司
地址:北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层
联系电话:010-68083368
传真:010-68083078
(3) 上海分公司
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室
联系电话:021-68885311
传真:021-68885200
(4) 网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。
本公司网上交易系统网址:www.gtfunds.com.cn
本公司网站:www.gtfunds.com.cn
客服电话:95106828(免长途费)或020-83936999
客服电话:020-34281105

(5) 投资者也可通过本公司客户服务热线进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。
2. 代销售机构
(1) 名称:青岛银行股份有限公司
注册地址:山东省青岛市市南区香港中路68号
法定代表人:郭少军
联系人:滕克
联系电话:0632-85709787
传真:0632-85709799
客服电话:(青岛)96588,(全国)400-66-96588
公司网站:www.qdccb.com

二、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
法定代表人:王志伟
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89118870
传真:020-89899175
联系人:李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:德恒律师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢俊
联系人:洪韵琦
电话:021-61418888
电话:011-51161906
传真:021-63360003
经办注册会计师:王明静、吴迪

第四部分 基金的名称

广发活期宝货币市场基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,具体如下:
1. 现金;
2. 通知存款;
3. 短期融资券(包括超短期融资券);
4. 1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;
5. 期限在1年以内(含1年)的债券回购;
6. 剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
7. 剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
8. 剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据;
9. 期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
10. 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。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

第八部分 基金的投资策略

一、投资策略
本基金将在深入研究国内外宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。
(一)利率预期策略
影响利率走势的因素很多,影响短期利率变动的因素更多,运行方式也更为复杂。基金管理人将重点考虑以下两个因素:
1. 中央银行、财政部等国家宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场运行的影响非常深远。国家宏观经济管理部门尤其是中央银行对经济运行形势的判断及采取的政策是影响市场利率走势的关键因素之一。
2. 短期资金供求变化。短期资金市场参与者的头寸宽紧程度是短期利率变动的重要主导力量。短期利率随短期资金供求变化呈现一定的季节性波动形态。
具体而言,本基金管理人将持续跟踪反映国民经济发展的宏观经济指标,对宏观经济政策进行深入分析,进而对短期利率的变化趋势及时反应。重点关注宏观经济指标包括:国家经济管理(政策、预期物价指数、相关市场资金供求关系等等)。

(二)期限配置策略
在短期利率期限结构分析的基础上,根据对投资对象流动性及收益性的动态考察,构建期限结构投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般来说,预期利率上升时,将适当缩短组合的平均期限;预期利率下降时,将在法律法规允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

(三)品种配置策略
在短期利率期限结构分析和品种深入分析的基础上,进行品种合理配置。当预期利率上升时,可以增加回购资产的比重,适度降低低债券资产的比重;预期利率下降,将降低回购资产的比重,增加债券资产的比重。

(四)银行定期存款及大额存单投资策略
银行定期存款及大额存单是本基金的主要投资对象,因此,银行定期存款及大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。具体而言,在组合投资过程中,本基金将在综合考虑本收益的基础上,尽可能的扩大交易对手的覆盖范围,通过对这些银行广泛、耐心而细致的询价,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款及大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。

(五)套利策略

在久期控制的基础上,本基金管理人将货币市场的各个细分市场进行深入研究分析,在严格控制风险和保障流动性的前提下,寻找跨市场、跨期限、跨品种的套利投资机会,以期获得更高的收益。当然,由于交易对手的限制,目前挖掘套利投资机会的投资方式主要是用风险相当,但收益更高的品种替代收益较低的品种,或者用收益相当,风险较低品种

替代风险较高的品种。

(六)流动性管理策略

流动性好是货币市场基金的重要特征之一。在日常的投资管理过程中,本基金将会密切关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。

具体而言,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性债券、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等配置,以满足日常的资金资产变现需求。

二、投资决策依据和投资程序

(一) 投资决策依据

1. 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2. 宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。

(二) 投资决策程序

1. 投资决策委员会制定整体投资策略。
2. 固定收益部研究员根据自身或者其他研究机构的研究成果,形成利率走势预测、品种配置建议等,为投资决策提供支持。
3. 固定收益基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,结合研究员的研究报告,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、目标久期、期限结构、个券选择等投资方案。

4. 投资决策委员会对固定收益基金经理小组提交的投资组合进行论证分析,并形成决议纪要。

5. 根据决议纪要,固定收益基金经理小组具体的投资组合及操作方案,交由中央交易部执行。

6. 中央交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈至基金经理小组。
7. 基金绩效评估与风险管理小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险,定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和建议和改进方案。

第九部份 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。
本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

第十部分 风险收益特征

本基金属于货币市场基金,风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
十一部分 基金投资组合情况

基金管理人的真实性及董事事保证本投资组合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。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月18日复核了本投资组合的财务指标、净值表现和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。本投资组合报告所载数据截至2015年12月31日。

12.期末按资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	128,915,748.78	41.31
	其中:债券	128,915,748.78	41.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	76,471,023.89	24.50
3	买入逆回购金融资产	40,470,849.89	13.07
4	银行存款和结算备付金合计	103,432,072.51	33.14
4	其他货币资金	3,264,072.00	1.06
5	合计	312,083,718.06	100.00

12.2.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	14.33
	其中:中央国债登记结算	-
	其他	-
2	报告期末债券回购融资余额	46,983,777.07
	其中:中央国债登记结算	-

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
本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

12.3.投资组合平均久期限制基本情况
项目 天数

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	302
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36
报告期内投资组合平均剩余期限限制	180

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期末,本基金未发生超标情况。

12.3.2.期末按债券品种平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	报告期内资产占基金资产净值的比例(%)	报告期内负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.07	17.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	90天(含)-180天	52.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	180天(含)-397天	26.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	397天(含)-597天	7.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	其他	-	-
合计	116.20	100.00	17.26

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
本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

12.3.1.投资组合平均久期限制基本情况
项目 天数

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	302
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36
报告期内投资组合平均剩余期限限制	180

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期末,本基金未发生超标情况。

12.3.2.期末按债券品种平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	报告期内资产占基金资产净值的比例(%)	报告期内负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.07	17.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	90天(含)-180天	52.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	180天(含)-397天	26.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	397天(含)-597天	7.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	其他	-	-
合计	116.20	100.00	17.26