

# 嘉实稳华纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司  
基金托管人：招商银行股份有限公司

嘉实稳华纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2016年10月12日证监许可[2016]2321号《关于准予嘉实稳华纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金合同于2017年01月11日正式生效,自该日起基金管理人开始管理本基金。

投资有风险,投资者投资于本基金前应认真阅读本招募说明书。本基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件,基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人,基金合同当事人,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《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者认购、申购基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,基金合同自基金份额认购之日起生效。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年6月14日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日(未经审计)。

## 一、基金管理人

### (一)基金管理人基本情况

1.基本信息	
名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期2903-101室
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街甲9号华贸大厦
法定代表人	刘天祥
成立日期	1999年3月25日
注册资本	15亿元人民币
股权结构	中信证券有限责任公司40%、德意志资产管理(亚洲)有限公司30%、招商证券股份有限公司30%
存续期间	持续经营
存续期间	(010) 65215888
电话	(010) 61912678
联系人	田明

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]6号文批准,于1999年3月25日成立,是中国第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金基金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

1.基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况  
牛成立先生,联席董事长,经济学硕士,中共党员。曾任中国人民银行,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任。

王卫女士,董事长,硕士研究生,中共党员。曾任证监会办公厅主任,中国证监会办公厅主任,中国证监会办公厅主任,中国证监会办公厅主任,中国证监会办公厅主任,中国证监会办公厅主任。

孙庆瑞先生,董事,金融学博士,中共党员。曾任中国人民银行,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任。

王巍先生,董事,金融学博士,中共党员。曾任中国人民银行,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任。

王忠文先生,董事,金融学博士,中共党员。曾任中国人民银行,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任,中国建设银行总行资产负债管理部主任。

田惠宇先生,本行行长,执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。中国科技大学工商管理硕士学位,高级经济师。曾任2003年7月至2013年5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上海市分行行长。

王良先生,本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行拓展部总经理、三环支行执行助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理;2016年1月起担任本行副行长;2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士,招商银行资产管理部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人从业资格。先后供职于中国工商银行黑龙江分行,华夏银行,中国农业银行总行,从事信贷管理、信贷工作。2002年10月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产管理部副经理、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业务从业经验。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研究和丰富的业务经验。

### (二)基金托管人基本情况

截至2018年3月31日,招商银行股份有限公司托管资产36只开放式基金。

### (四)托管人的内部控制制度

1. 内部控制目标  
确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整,建立有利于控制风险、有效提高内部控制效率和风险管理水平的内部控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内部控制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

### 2. 内部控制组织结构

招商银行资产管理部建立三级内控制度风险防范体系:  
一级风险防范是在招商银行总行层面设立风险防范和控制;  
二级风险防范是在招商银行资产管理部设立风险监控室,负责部门内部风险防范和控制;

三级风险防范是在招商银行资产管理部设置专业岗位时,遵循内部控制制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度而定。

### (1) 全面性原则: 内部控制覆盖各项业务过程和操作环节,覆盖所有重要岗位,并由全体人员参与。

(2) 审慎性原则: 托管机构参与内部控制制度的建立均以风险防范、审慎经营为出发点,体现“内控优先”的要求,以有效防范各种风险作为内部控制的核心。

(3) 独立性原则: 招商银行资产管理部各、各岗位职责相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制由独立的部门独立于内部控制制度执行部门。

(4) 有效性原则: 内部控制具有权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权利,内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则: 内部控制适应招商银行托管业务风险管理的要求,并能随着托管业务经营战略、经营方式、经营理念等内部环境的变化和风险管理、法规、政策等外部环境的变化及时进行调整和完善。

(6) 防火墙原则: 招商银行资产管理部配备独立的托管业务技术系统,包括核算系统、应用系统、安全防御系统、数据备份系统。

(7) 重要性原则: 内部控制在实现全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则: 内部控制形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

### 4. 内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产管理部对托管业务操作程序、会计核算、资金管理、岗位设置、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度,保证托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 经营风险控制。招商银行资产管理部制定托管业务审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程,有效防范和控制操作风险。

(3) 基金财产风险控制。招商银行资产管理部在数据传输和备份方面实行严格的加密和备份措施,采用加密、直连方式传输数据,数据执行异地实时备份,所有的业务信息经过严格的授权方可进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产管理部对客户业务办理流程中形成的客户资料,视同客户商业秘密,客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经信息系统审批,并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行信息技术系统管理实行双人双岗双机,机房24小时值班并设置门禁管理,电脑病毒设置及权限管理、业务网络备份、托管业务网与全行业务网双防火墙,与外部业务机构实行防火墙保护,对信息技术系统采取多层次、多环节的应急备份措施,保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产管理部建立良好企业文化及员工培训、激励约束、绩效、人力资源管理和员工队伍教育及人才储备机制,有效的提升人力资源管理水平。

(7) 基金财产风险控制。招商银行资产管理部在托管业务的方法和程序上,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定,对基金投资范围、投资比例、投资品种等的合法性、合规性的监督和核查。

在基金托管运作所涉及的基金核算和核算环节环节中,基金托管人对基金管理人发送的指令进行复核,基金管理人对基金托管人的指令进行监督检查,对违反法律法规、基金合同的各项指令拒绝执行,并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定,及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法律法规及基金合同中的托管协议。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人向基金托管人提交的违规事项未在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

### 相关服务机构

#### (一)基金份额发售机构

##### 1.直销机构

(1)嘉实基金管理有限公司直销中心  
办公地址:北京东城区建国门内大街7号北京嘉实中心9层C1212室  
电话:(010) 65215888 传真:(010) 65216777  
联系人:魏佳

(2)嘉实基金销售有限公司上海直销中心  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2903-11单元  
电话:(021) 38796666 传真:(021) 68880023  
联系人:邵琦

(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司  
办公地址:成都市高新区交子大道17号中国银泰中心A座2110A-06单元  
电话:(028) 186232100 传真:(028) 186232100  
联系人:王坤

(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司  
办公地址:深圳市福田区益田路6001号平安金融大厦16层  
电话:(0755) 84362000 传真:(0755) 25870063  
联系人:陈黎芳

(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司  
办公地址:青岛市市南区江苏路6号海信广场3101室  
电话:(0532) 66777887 传真:(0532) 66777676  
联系人:胡洁

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司  
办公地址:杭州市下城区四季青路南都银泰中心1101A室  
电话:(0571) 88061382 传真:(0571) 88021281  
联系人:王璇

(7)嘉实基金管理有限公司广州分公司  
办公地址:福州路德区五马路139号广生行广场01A单元  
电话:(020) 88013670 电话:(020) 88013670  
联系人:梁颖珊

(8)嘉实基金管理有限公司南京分公司  
办公地址:南京市白下区中山东路289号新锦泰广场A座4002室  
电话:(025) 66671118 传真:(025) 66671100  
联系人:陈婉璐

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司  
办公地址:广州市天河区珠江新城华夏路10号富力盈香广场01A单元  
电话:(020) 188323275 传真:(020) 181522120  
联系人:魏佳

##### 2.代销机构

1. 椒城(杭州)基金销售有限公司  
办公地址:杭州市椒江区前湾大道1181号1218室202室  
注册地:杭州市椒江区前湾大道1181号1218室202室  
法定代表人:陈柏青 联系人:陈柏青  
电话:0571-86897940 传真:0571-26897013  
网址: http://www.hund1218.cn 客服电话:4000-796-123

(2) 登记机构  
名称:嘉实基金管理有限公司  
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期2903-101室  
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街甲9号华贸大厦  
法定代表人:刘天祥  
电话:010-65215888  
传真:(010) 61912678  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海市锦天城律师事务所  
住所:办公地址:上海市浦东新区银城中路26号华厦银行大厦14楼  
负责人:廖海 联系人:刘佳  
电话:(021) 151150288 传真:(021) 51150388  
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(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9楼  
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中111楼  
法定代表人:李丹 联系人:张勇  
电话:(021) 12323888 传真:(021) 12323800  
经办注册会计师:陈震、张磊

### 四、基金的名称

本基金名称:嘉实稳华纯债债券型证券投资基金  
本基金类型:债券型

### 六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 七、基金的投资范围

本基金主要投资于国债、金融债、企业债、可转债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、国债期货、现金,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但

须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

### 八、基金的投资策略

#### 1. 债券投资策略

本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种固定收益类资产在特定经济形态下的估值水平、预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,制定组合久期和久期期限结构及类属配置,并在此基础上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资收益。

#### (1) 利率策略

本基金将对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,积极主动的预测未来的利率走势。组合久期是反映利率风险最重要的指标,本基金管理人将根据相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,以减小债券价格下降带来的风险。

#### (2) 信用债投资策略

本基金通过承担适度的信用风险来获取信用溢价,主要通过个别债券的选择和行业配置策略,构造和优化组合。

通过采用“嘉实信用分析系统”的信用评级和信用分析,包括宏观信用环境分析、行业趋势分析、管理层素质与公司治理分析、运营与财务状况分析、财务契约分析、特殊事项风险分析等,依靠嘉实信用分析团队及嘉实中央研究院支持的实地调研、深入数据挖掘发信体的经营现状、现金流、发展趋势等情况,严格遵守嘉实信用分析流程,执行嘉实信用投资纪律。

#### ① 个别债券选择

首先,本基金依据“嘉实信用分析系统”的研究成果,执行“嘉实投资备选库策略”,生成或更新发行人信用债券备选库,强化投资纪律,保护组合质量。

其次,本基金主要从信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类属、信用评级、收益率、到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息偿付频率、剩余额久期、凸性、流动性(发行总量、流通量、上市时间)等指标,结合组合管理面的要求,决定是否将个债纳入组合及其投资数量。

再有,因信用改善而支持本基金投资的个债信用指标可以包括但不限于:更稳定或增强的现金流,通过自由现金流增强去杠杆的财务能力、资产价值回升支持债券,更强大的信用管理,更稳定或更高的市场占有率,更利于获得资金等;个债因信用恶化而支持本基金卖出的指标可以包括但不限于:发债企业出现不利于分析师预期的情况,发债企业资产负债率下降,发债企业取得新的资产减少,发债企业市场地位恶化,发债企业取得新的资产减少,发债企业生产运营层的重大变化,个债已达到本基金对其设定的目标价格,本基金对该个债评估的价格上行空间有限等。

#### ② 违约风险

违约风险环境影响,影响同一发行人的违约概率,影响不同发行人之间的违约相关性,影响预期违约等级及发行人在信用周期不同阶段的违约损失率,影响不同信用等级发行人的违约率等。同时,不同行业对宏观经济的相关性存在差异,不同行业的潜在违约率存在差异。本基金在宏观“嘉实信用分析系统”及嘉实中央研究院平台,基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本研究,运用定量模型,在自下而上的个债选择策略基础上,采取适度分散的行业配置策略,从组合层面动态优化风险收益。

#### ③ 信用风险控制措施

本基金实施谨慎的信用评估和市场分析,个债和行业层面的分散化投资策略,当发债企业的基本面出现恶化时,运用“尽早出售(first sale, best sale)”策略,控制投资风险。

本基金采用信用评级持续监控,组合持仓分布、各项重要债信用评级等连续性统计指标,灵活运用VaR, Credit Metrics, Credit Portfolio Views等模型,估计组合在给定置信水平和事件期限内可能遭受的最大损失,以便有效评估和控制组合信用风险暴露。

#### (3) 期限结构配置策略

本基金通过对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,在给定组合久期及其他组合约束条件的情况下,通过调整债券组合优化数量,确定最合理的期限结构。本基金期限结构配置的策略包括哑铃策略、哑铃策略和梯形策略。

#### (4) 策略策略

本基金采用哑铃策略增强组合的持有期收益。当收益率曲线比较陡峭时,即当期短期利率较大时,可以买入期限处于收益率曲线陡降处的债券,也即买入水平处于相对高位债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,相应的债券水平将会持有期收益初有所下降,这样就能够获得丰厚的价差收益即资本利得以收入。

#### (5) 息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资收益。

#### (6) 中小企业私募债券投资策略

本基金将通过中小企业私募债券发行进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程,风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,以防范信用风险、流动性风险和利率风险等各种风险。

#### 2. 国债期货投资策略

本基金将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上,研判利率债品种的中长期表现,在有效控制组合杠杆水平的基础上,充分利用国债期货保证金交易特点,灵活调整组合国债期货多头仓位。

#### (2) 国债期货的套期保值

本基金在综合分析经济基本面、利率风险和策略面的基础上,结合组合内利率债持仓结构的基础上,按照“利率风险评估一套期保值比例计算—保证金、期现价差或风险对冲”的流程,构建并实施套期保值。

#### (3) 信用利差策略

利率风险是信用的重要风险成因。本基金将在基于经济形势和信用风险预期的基础上,利用国债期货,对于信用的利率风险部分进行一定程度的套期保值,实现信用利差交易,即在预期信用利差缩窄的情况下,做空国债期货,做多信用债,在预期信用利差缩宽的情况下,做多国债期货,做空信用债。

#### 3. 资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品政策框架下,通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制投资资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

#### 4. 投资决策依据和决策程序

##### (1) 投资决策依据

● 法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的相关规定。

● 宏观经济和上市公司的基本面数据。

● 投资对像的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的前提下,选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

##### (2) 投资决策程序

● 公司研究部通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金管理人提供决策依据。

● 投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据本基金投资目标和对市场的判断决定重大投资的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资计划。

● 在既定的投资目标与原则下,根据分析師研究报告并进一步研究成果以及定量投资策略,由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资;

● 独立的交易执行:本基金管理人通过公平交易的制度和实时的风险监控机制,保证基金经理的投资指令合法、合规的前提下得到有效地执行。

● 动态的组合管理:基金经理将跟踪证券市场 and 上市公司的发展变化,结合本基金的现金流量情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整,使之不断得到优化。

风险管理小组根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控,并按风险控制小组适时进行日常跟踪,出具风险评估报告。监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

#### 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债总全价指数收益率

中债总全价指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的综合反映银行间债券市场、上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债券指数。该指数样本券涵盖国债、金融和政策性金融债,能较好地反映债券市场的整体收益情况。

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑:

1、中债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并公开发布,具有较强的权威性和市场影响力;

2、在可投资债券体系中,中债总全价指数所代表的债券市场的风险收益特征与本基金较为贴近。因此,中债总全价指数比较适合作为本基金业绩比较基准。

如果中债总全价指数编制发布机构停止编制或调整该指数或更改指数名称,相关法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

#### 十、基金的风险控制特征

本基金为债券型证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基金、混合型证券投资基金。

#### 十一、基金信息披露

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年4月18日复核了本报告中的财务指标、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。

本招募说明书报告所载数据截至2018年3月31日(“报告期末”),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	权益投资	--	--
其中:股票	--	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	397,498,246.20	97.44
其中:债券	397,498,246.20	97.44	
资产支持证券	--	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--	--
7	其他资产	2,402,468.13	0.60
其中:期货及结算备付金合计	--	--	--
8	其他资产	8,000,385.31	1.99
9	合计	407,961,066	