

工银瑞信安盈货币市场基金更新的招募说明书摘要 (2018年第2号)

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2016年4月8日证监许可〔2016〕747号文注册。本基金的基金合同于2016年12月2日正式生效。
投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。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接受基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、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。

投资者购买货币市场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。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2018年10月26日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年9月30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

名称：工银瑞信基金管理有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号、甲56层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6—9层
邮政编码：100033
法定代表人：郭特华
成立日期：2005年6月21日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93号
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
联系人：朱碧艳
联系电话：400—811—9999

股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的80%；瑞士信贷银行股份有限公司占公司注册资本的20%。

存续期间：持续经营
(二) 主要人员情况

1、董事会成员
尚军先生，董事长，中国工商银行战略管理与投资者关系部资深专家、专职派出董事。复旦大学工商管理（国际）硕士，高级经济师。历任中国工商银行河南郑州分行团委书记、国际部副经理，河南分行国际部总经理、储蓄处处长、国际业务处处长，河南分行副行长、党委书记、行长等职务。
Levin先生，董事，瑞士信贷银行资深专家，亚太区资产管理主管。Levin先生负责指导亚太区资产管理战略，包括销售、产品和合作伙伴关系。他还与机构和私人银行密切合作，以提供资产管理投资解决方案。在2011年8月加入瑞士信贷之前，Levin先生是AsiaCrest Capital的首席执行官，AsiaCrest Capital是一家位于香港的对冲基金PoP。再之前，他曾在怡和集团和英仕曼集团担任投资组合经理。Levin先生也是Metropolitan Venture Partners的联合创始人。他在流动和非流动另类投资行业拥有超过20年的经验。Levin先生毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院，并获得经济学学士学位。

郭特华女士，董事，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事长。历任中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副部长，中国工商银行总行资产托管部处长、副总经理。

王一心女士，董事，高级经济师。中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、专职派出董事。历任中国工商银行专项融资部（公司业务二部、营业部）副总经理；中国工商银行营业部 历任副处长、处长；中国工商银行总行技术运营信贷部总经理。
王莹女士，董事，高级会计师，中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、专职派出董事。于2004年11月获得国际内部审计师内部审计师（Certified Internal Auditor）资格证书。历任中国工商银行国际业务部外汇清算处负责人，中国工商银行清算中心外汇清算处负责人、副处长，中国工商银行稽核监督局外汇业务稽核处副处长、处长，中国工商银行内部审计局境外机构审计处处长，工行悉尼分行内部审计师、风险专家。

田海鹏先生，独立董事，经济学博士。上海财经大学经济学院院长，上海财经大学高等研究院院长，美国加州ARM大学经济学教授Alfred F. Chalk讲席教授。首批中国“千人计划”入选者及美国国家特聘专家，首批人文社会科学长江学者讲座教授，曾任上海市人民政府特聘决策咨询专家，中国管理经济学会会长（1991—1992）。2006年被《华尔街电讯》列为中国大陆十大最具影响力的经济学家之一。主要研究领域包括经济理论、激励与机制设计、中国经济转型。

葛新雄女士，独立董事，管理学博士，高级经济师。2017年12月起担任北京创新伙伴教育科技有限公司董事。2005年3月至2017年12月任职于中央汇金投资有限公司，曾任汇金公司股权监事、银行一部副主任（董事总经理）。2001年9月至2005年3月任职于中国证监会发行监管部，1998年8月至2001年9月任北大鹏程证券（北京）研究部副研究员。1994年7月至1998年8月在北大工业大学工商管理学院任讲师。

Alan H. Smith先生，独立董事，法学学士，香港大律师，香港律师公会会员。历任云顶香港有限公司副董事长，怡和集团控股有限公司董事长，香港大学法律专业讲师，恒生指数顾问委员会委员，香港医院管理局公积金计划受托人，香港证监会复核委员会委员，香港政府经济顾问委员会发展局成员，香港联合交易所市场发展工作小组主席，曾被《亚洲周刊》杂志评为“年度银行家”。

2、监事会成员
郑剑锋先生，监事，金融学双硕士。2005年12月起，郑剑锋先生任职于中国工商银行监事办公室，先后担任综合管理处处、监督专员和监事会办公室副主任，主要负责合规、内控及董事董董履职的监督检查工作。2014年6月起，郑剑锋先生被任命为中国工商银行战略管理与投资者关系部集团派驻子公司监事室办公室高级专家、专职派出董事。

黄敏女士，监事，金融学学士。黄敏女士于2006年加入Credit Suisse Group（瑞士信贷集团），先后担任全球投资银行战略助理副总裁、亚太区投资银行战略助理副总裁、中国区执行首席运营官、资产管理中国区首席运营官，现任资产管理中国区负责人。

洪波女士，监事，硕士。ACCA 非执业会员。2005年至2008年任安永华明会计师事务所高级审计员；2008年至2009年任民生证券有限责任公司监察稽核部业务主管；2009年6月加入工银瑞信法律合规部，现任内控稽核部总监。

倪晋女士，监事，硕士。2000年至2009年任职于中国人民大学，历任副科长、科长，校团委副书记。2009年至2011年就职于北京市委教工委，任干部处副调研员。2011年加入工银瑞信战略发展部，现任人力资源部总监。

章晓红女士，监事，硕士。2001年至2003年任职于南京市委教工委；2003年至2005年任职于银河基金，担任注册登记专员。2005年加入工银瑞信运作部，现任中央交易室总监。

3、高级管理人员
郭特华女士，总经理，简历同上。
朱碧艳女士，硕士，国际注册内部审计师，现任工银瑞信基金管理有限公司督察长，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司监事。1997—1999年中国华能信托投资公司证券总部总经理，2000—2005年中国华融资产管理公司投资银行部、证券业务部高级经理。

孙海涛先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事。1997年7月至2002年9月，任职于长城证券有限责任公司，历任研究员、债券（金融工程）研究员；2002年10月至2003年5月，任职于宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理；2003年6月至2006年3月，任职于招商基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

赵絮女士，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信投资管理有限公司董事，1989年8月至1993年8月，任职于中国工商银行海淀支行，从事国际业务；1993年6月至2002年4月，任职于中国工商银行北京市分行国际业务部，历任综合科科长、国际业务部副总经理；2002年6月至2006年4月，任职于中国工商银行牡丹卡中心，历任市场部副经理、清算部副经理。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

郝伟先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事。工银瑞信投资管理有限公司董事。2001年4月至2006年6月，任职于中国工商银行资产托管部。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

4、本基金基金经理
魏殿顺先生，5年证券从业经验。2013年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。2016年9月19日至至今，担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理；2016年9月19日至至今，担任工银瑞信活期宝货币市场基金基金经理；2016年9月19日至至今，担任工银瑞信现金快线货币市场基金基金经理；2017年4月14日至至今，担任工银瑞信安盈货币市场基金基金经理。

5、投资决策委员会成员
郭特华女士，简历同上。

孙海涛先生，投资决策委员会主任，简历同上。

宋炳坤先生，14年证券从业经验；曾任中信建投证券有限公司研究员；2007年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2012年2月14日至至今，担任工银瑞信添利混合型证券投资基金基金经理；2013年1月18日至至今，担任工银瑞信添利混合型证券投资基金；2013年1月28日至2014年12月5日，担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理；2014年1月20日至2014年8月28日，担任工银瑞信红利精选混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至2017年5月27日，担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理；2014年10月22日至至今，担任工银瑞信研究精选股票型证券投资基金；2014年11月18日至2018年8月28日，担任工银瑞信保恒行业股票型证券投资基金；2015年2月16日至2017年12月22日，担任工银瑞信转型主题股票基金基金经理；2017年4月12日至至今，担任工银瑞信中国领先2025股债配置型证券投资基金。

6、基金风控人员
欧庆新先生，16年证券从业经验；曾任中海基金管理有限公司基金经理；2010年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。2010年8月16日至至今，担任工银双利债券型基金基金经理。2011年12月27日至2017年4月21日担任工银保本混合基金基金经理，2013年2月7日至2017年2月6日担任工银现金2号特设型发起式基金。自2016年2月19日起变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金基金经理。2013年7月26日至2018年2月27日，担任工银瑞信恒保本3号混合型证券投资基金。2013年7月4日至2018年2月28日，担任工银瑞信纯债两年定期开放基金基金经理。2014年9月19日起至担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理。2015年6月26日起2018年6月5日，担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理。

黄安乐先生，15年证券从业经验；先后在澳大利亚源顺投资有限公司担任研究员，国信证券研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理。研究2010年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2011年11月23日至至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2013年9月23日至至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014年10月22日至2017年10月9日，担任工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金；2015年4月28日至2018年3月2日，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理；2016年1月29日至至今，担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理；2017年4月21日至至今，担任工银瑞信互联网+股票型证券投资基金基金经理；2018年3月28日至至今，担任工银瑞信中小企业成长混合型证券投资基金基金经理。2018年6月5日至至今，担任工银瑞信新经济灵活配置混合型证券投资基金（ODI）基金。

石正刚先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司投资总监。1990年至1996年，任职于荷兰银行台北分行，担任协理；1996年至2002年，任职于日本大和资信信托（香港）有限公司，担任资深投资经理；2003年至2004年，任职于台湾英国保诚投资信托公司，担任投资总监；2004年至2006年，任职于台湾汇丰中华投资信托公司，担任投资管理部副总监；2006

年至2008年，任职于国联安基金管理有限公司，担任副总经理兼投资总监；2008年至2013年，任职于台湾景顺投资信托公司，担任副总经理兼投资总监；2014年至2016年，任职于台湾中国人寿保险有限公司，担任全球权益市场负责人；2017年至2018年6月，任职于九旭投资资产公司，担任公司董事总经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人
名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
成立时间：1996年2月7日
基金托管业务批准文号：证监基金字〔2004〕101号
组织形式：其他股份有限公司（上市）
注册资本：28,365,585,227元人民币
存续期间：持续经营
电话：010-58560666
联系人：罗菲菲

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、直销机构
名 称：工银瑞信基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲56层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6—9层
法定代表人：郭特华
全国统一客户服务热线：400—811—9999
传真：010—66583111
联系人：宋倩芳
电话：010—66583233
公司网站：www.icbccs.com.cn
投资者还可通过本公司电子自助交易系统申购本基金。

2、其他代销机构
（1）上海煜煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
联系人：吴鸣飞
电话：021—5370077—268
传真：021—56065931
客户服务电话：400—820—5369
网址：www.yiyyfund.com.cn
（2）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王志刚
联系人：李瑞真
电话：010—56251471
传真：010—62680827
客户服务电话：400—619—9059
网址：www.hcjj.com

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）基金登记机构
名 称：工银瑞信基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲56层甲5号601、甲5号7层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
注册登记业务办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层
法定代表人：郭特华
全国统一客户服务热线：400—811—9999
传 真：010—66583100
联系人：朱晓晖

（三）律师事务所及经办律师
名 称：北京市天元律师事务所
住 所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人：宋小辉
电 话：010—57763888
传 真：010—57763777
经办律师：吴冠雄、李晓明

（四）会计师事务所及注册会计师
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318号锦泰大厦6楼6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
经办注册会计师：单峰、张勇
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238900
联系人：张勇

四、基金的名称

五、基金的类型

六、基金的投资目标

在控制风险并保障资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向
本基金主要投资于具有良好流动性的工具，包括现金；期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具。

法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

八、基金的投资策略

（一）投资策略
本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。

1、利率策略
通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

2、信用策略
根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状态、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，跟踪债券发行人和债券工具自身的信用质量变化，并结合外部权威评级机构的信用评级结果，确定基金资产对相应债券的投资决策。

考虑到当前稳增长是未来经济结构调整、过剩产能出清的重要发展战略，本基金将不投资于产能过剩或周期行业，行业运行处于低谷、节能环保投资较大的行业、板块，包括但不限于钢铁（含钢铁）、常用有色金属冶炼、有色金属压延加工、水泥、平板玻璃、造船、光伏制造、风电设备、石油钻采专用设备制造、机床制造、重型机械制造、煤炭（含煤炭、煤化工）、造纸和纸制品、印刷、化工、肥料制造、建材批发、航运、房地产等。

本基金投资于信用类债券，其信用评级应为AA+级（含）以上，债券发行人上年末净资产应在10亿元以上。

为控制本基金的投资风险，本基金将定期对所投资债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。

3、类属配置策略
研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场供求关系，以及不同时期市场投资热点、分析国债、金融债、企业债券等不同债券品种的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

4、个券选择策略
本基金认为普通债券的估值，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并找出因定价偏高、供求、流动性、信用利差等因素导致价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择出估值较低的债券品种。

对于含回售条款的债券，本基金将仅买入距回售日不超过397天以内的债券，并在回售日前进行回售或者卖出。

5、相对价值策略
本基金认为市场普遍存在看跌失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些因素之间的相对价值，也是本基金发现投资机会的重要方面。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动，通过深入分析市场参与者的立场和观点，充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者被错误定价等因素导致的市场失衡机会，形成相对价值投资策略，运用回购、远期交易等金融工具进行不同期限、不同品种或不同市场之间的套利交易，为本基金的投资带来增值收益。

6、资产支持证券投资策略
当前国内资产支持证券主要为以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产的信贷资产支持证券产品，本基金侧重于对其资产质量及未来现金流的分析，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险和定价评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险。

7、其他金融工具投资策略
本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动态，当法律法规允许本基金参与此类金融工具的投资，本基金将按照届时生效的法律法规，对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。经基金管理人及基金托管人协商一致后，本基金管理人可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券型基金，也低于股票型基金与股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

本报告期为2018年7月1日起至9月30日止（财务数据未经审计）。

1.1 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 567,389,161.66 44.07

其中：国债 567,389,161.66 44.07

2 货币市场工具 25,000,000.00 1.96

3 买入返售金融资产 280,841,788.28 20.99

其中：买入返售金融资产 280,841,788.28 20.99

4 其他资产 454,542,050.15 35.31

5 其他负债 4,585,344.24 0.36

6 资产支持证券 1,287,538,046.33 100.00

注：由于四舍五入的原因基金总资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

1.2 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 7.37

其中：买断式回购融资 0.00

序号 项目 金额（元） 占基金资产净值的比例（%）

1 报告期末债券回购融资余额 197,859,503.51 18.19

其中：买断式回购融资 0.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例指报告期内每个交易日融资产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
本基金债券正回购的资金余额没有超过基金资产净值20%的情况。

1.3 基金投资组合平均剩余期限
1.3.1 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 78

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 81

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 41

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天情况。

1.3.2 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（%） 各期限负债占基金资产净值的比例（%）

1 30天以内 26.07 18.19

其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率资产 — —

2 30天—60天 13.89 —

其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率资产 — —

3 60天—90天 61.79 —

其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率资产 — —

4 90天—120天 1.85 —

其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率资产 — —

5 120天—397天（含） 16.61 —

其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率资产 — —

6 合计 118.04 18.19

1.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本报告期内无货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

1.5 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） 占基金资产净值的比例（%）

1 国债投资 — —

2 央行票据 — —

3 金融债券 60,113,569.16 5.63

其中：政策性金融债 60,113,569.16 5.63

4 企业债券 — —

5 地方政府债 50,001,963.42 4.60

6 中期票据 — —

7 短期融资券 437,373,730.07 40.34

8 其他 — —

9 合计 547,389,161.66 50.37

10 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 — —

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

1.6 报告期末投资组合占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 证券代码 证券名称 债券数量（张） 摊余成本（元） 占基金资产净值的比例（%）

1 111810443 18国债银行 CD443 1,000,000 99,456,179.65 9.15

2 111801365 18国债银行 CD165 1,000,000 99,364,159.72 9.14

3 111810463 18国债银行 CD463 1,000,000 99,363,618.04 9.14

4 111809081 18国债银行 CD981 500,000 49,747,389.81 4.58

5 111808167 18国债银行 CD167 500,000 49,723,013.66 4.58

6 140002 14国债02 200,000 20,140,201.56 1.86

7 170111 17进出11 200,000 20,019,134.70 1.84

8 110101566 18国债银行 CD1566 200,000 20,000,274.34 1.84

9 111884161 18国债银行 CD1613 200,000 19,888,756.32 1.83

10 111885216 18国债银行 CD1616 200,000 19,729,982.87 1.82

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

1.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在0.25%—0.5%间的次数 0