

## 嘉实薪金宝货币市场基金更新招募说明书摘要

(2018年第2号)

基金管理人:嘉实基金管理有限公司  
基金托管人:中信银行股份有限公司

## 重要提示

本基金根据2014年4月8日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实薪金宝货币市场基金募集的批复》(证监许可[2014]375号)和2014年4月18日《关于嘉实薪金宝货币市场基金募集时间安排的确认函》(证监机构部函[2014]31号)的注册公开发售,本基金基金合同于2014年4月29日正式生效,自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
本基金将根据基金合同和招募说明书编写,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《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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应仔细阅读基金合同。

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。  
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者存款类金融机构。

本招募说明书已在本基金管理人网站、本招募说明书所载内容截止日为2018年10月29日(特别注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(未经审计)。

## 一、基金管理人

## (一)基金管理人基本情况

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33层01-11单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街8号华润大厦8层
法定代表人	赵学军
成立时间	1999年6月26日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中国工商银行股份有限公司40%、德意志资产管理(亚洲)有限公司30%、立信投资有限公司30%
存续期限	持续经营
电话	(010) 65251688
传真	(010) 65418579
联系人	胡晓莹

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]65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、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理、QDII资格和特定资产管理业务资格。

## (二)主要人员情况

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  
牛成先生,联席董事长,经济学硕士,中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长,中国银行厦门分行党委委员、副行长(挂职);中国银行业监督管理委员会(下称银监会)非银行金融机构监管部处长;银监会新疆监管局党委书记、副局长;银监会银行监管四部副主任;银监会黑龙江监管局党委书记、局长;银监会政策性担保业务工作组(政策性担保业务管理司前身)联席工作会议(办公室)主任;中信信托有限责任公司党委书记、总裁。现任中信信托有限责任公司党委书记、董事长,兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事长、总裁。

赵学军先生,董事长,党委书记,经济学博士。曾就职于天津通信广播集团电视设计所,外经贸部中国仪器进出口总公司,北京国际交易所,天津纺织新材料研究所,商鼎商业经纪有限公司,北京证券有限公司,大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理,2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任保监会财务部资金运用处主任科员;国都证券有限责任公司研究部高级经理;中牧基金管理有限公司董秘兼发展战略部;现任中信信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理,兼任中国国际资本有限公司总经理,深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

高峰先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副副总裁,美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长,2008年至今任德意志银行(中国)有限公司董事长、德意志银行集团中国区总经理。

Jonathan Paul Eitbeck先生,董事,英国籍,南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问,JP Morgan固定收益亚太区CFO,COO,JP Morgan Chase固定收益亚太区CFO,COO,德意志银行资产管理与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩东乐先生,董事,1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今,任北京德恒有限责任公司总经理;2001年11月至今,任立信投资有限公司董事长。

王巍先生,独立董事,美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行业国际研究所助理研究员,美国投行分析师,美国世界银行顾问,中国南方证券有限公司副总,万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编,法商集团副总,“中国法苑”丛书编辑委员会成员。曾兼任中国证券投资基金业协会第一届、第二届并购重组专业委员会委员,兼任任上海证券交易所上市公司委员会委员,中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生,独立董事,管理学博士,会计学教授,注册会计师,中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生导师等职。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼MBA教育中心主任。张树忠先生,监事长,经济学博士,高级经济师,中共党员。曾任华夏证券有限责任公司银行部总经理、研究发展部总经理;光大证券公司总裁助理、光大总部总经理、资产管理总监;光大德信基金管理公司董事、副总经理;大通证券股份有限公司副总经理、总经理;大成基金管理有限公司董事长,中国人保资产管理股份有限公司副总裁,首席投资执行官;中信信托有限责任公司董事长、党委副书记。现任中信信托有限责任公司党委副书记、总裁,兼任中诚资本管理(北京)有限公司董事长。

柳辉先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教,长安信息产业(集团)股份有限公司董事会秘书,北京德恒律师事务所财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚薇女士,监事,中共党员,博士应届生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部,历任人力资源部高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年7月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国浩律师集团(北京)事务所证券部律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部,法律部,现任法律部总监。

经雷先生,总经理,金融硕士,会计学专业本科学历,工商管理学士学位,特许金融分析师(CFA)。1998年至2008年在美国国际集团(AIG)国际投资公司美国纽约总部担任研究分析师。2008年10月至2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监,首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司,历任董事总经理(MD)、机构投资和固定收益业务首席投资官;2018年4月起任公司总经理。

宋瑞娟女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行政管理部任职处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任督察员和公司副总经理。

王屹女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院,北京市陆通联合律师事务所,北京市海浩律师事务所,新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生,副总经理,硕士研究生。历任国泰证券研究所研究员,国泰君安证券研究所副经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生,副总经理,工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监,南方证券金融研究所总经理助理,南方基金运作副总监,嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2.基金管理人

(1)现任基金管理人  
李金仙先生,硕士研究生,具有基金从业资格,CFA,9年证券从业经历。曾任Putox Trading Ltd期货交易员,北京首创期货有限责任公司研究员,建信基金管理有限责任公司担任债券交易员,2012年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任债券交易员,现任职于固定收益业务体系固定收益部alpha策略组。2015年6月9日至今任嘉实超短债债券和嘉实货币基金经理,2016年2月5日至今任嘉实机构快债货币基金经理,2016年7月23日至今年任嘉实货币基金和嘉实理财7天债券基金经理,2016年12月27日任嘉实薪金宝货币基金经理,2017年5月24日至今年任嘉实1个月理财债券基金经理,2017年5月26日任嘉实活期货币、嘉实快包货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实1个月理财债券基金经理,2017年6月29日至今年任嘉实6个月理财债券基金经理。2016年1月28日至今年任嘉实国际业务、市场部开发及深圳发展银行国际业务部、资金交易中心、南方基金固定收益部总经理、首席宏观研究员,第一创业证券资产管理部固定收益总监,执行总经理,民生证券资产管理总部助理兼投资研究部总经理。2007年6月16日至2009年10月20日任南方现金红利基金经理。2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任公司固定收益业务体系固定收益部alpha策略组组长,经济金融学博士,中国国籍。2013年7月5日至2014年7月16日任嘉实信用债券和嘉实增利收益定期债券基金经理,2013年9月4日至2014年19日任嘉实丰盈策略定期债券基金经理,2013年12月11日至今年任嘉实理财财富时申债券货币市场基金基金经理,2014年12月18日至今年任嘉实货币市场基金基金经理,2014年4月17日至今年任嘉实快包货币基金经理,2014年6月27日至今年任嘉实3个月理财债券基金经理,2015年4月25日至今年任嘉实快债货币市场基金经理,2017年3月29日任嘉实现金添利货币基金经理,2017年5月24日至今年任嘉实货币基金经理,2017年6月19日至今年任嘉实1个月理财债券基金经理。2017年4月24日至今年任基金基金经理。

(2)历任基金经理  
2014年4月29日至2017年5月24日,魏莉女士任本基金基金经理。

3.债券投资决策委员会  
债券投资决策委员会的成员包括:公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系策略组组长王屹女士、方晓西先生、胡永青先生,以及养老金固收投资组长王环怀先生。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)  
住所:北京市朝阳区朝门北大街9号  
办公地址:北京市朝阳区朝门北大街9号  
法定代表人:李庆萍  
成立时间:1987年4月20日  
组织形式:股份有限公司  
注册资本:489.3亿元人民币  
存续期间:持续经营  
批准设立文号:中国人民银行和国府办函发[1987]14号  
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号  
联系人:中信银行资产托管部  
联系电话:4006900000  
传真:010-85232004  
客服电话:95588  
网址:bank.ecitic.com

经营范围:保险兼业代理业务(有效期至2020年09月03日);代收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理发行与兑付金融债券;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动。)

中信银行(001985.HK,09616.HK)成立于1987年,原为中国国际信托投资公司,后经改革开放后中国最早兴办的新兴股份制银行之一,是中国最早与国外金融机构开展合作、并以原创中国现代金融史上多个“第一”而蜚声海内外的、伴随中国经济的快速发展,中信银行在中国金融市场改革的大潮中茁壮成长,于2006年8月,正式更名为“中信银行”。同年,成功引进战略投资者,与澳洲领先的西班牙对外银行(BIYA)建立了优势互补的战略合作关。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功上市。2009年,中信银行成为内地首家引入国际知名金融机构作为有限公。一家:获中央银行具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年,中信银行通过了美国AS700内部控制审计并获美国保留意见的AS700审计报告,表明了独立公正第三方对中信银行内控管理流程的风险管理和内部控制的有效性予以认可。

## 三、主要人员情况

孙卿璐先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起担任本行行长。孙先生同时担任中信银行(国际)董事长。此前,孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长;2014年3月起担任本行执行董事;2011年12月至2014年5月任本行副行长;2011年10月起任本行党委副书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总监兼交通银行北京市分行党委书记、行长;2005年12月至2009

年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长;1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心(北京)等单位工作,1996年12月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999年1月至2004年4月曾任中国人民银行数据中心(北京)总经理;1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行,孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学位。

杨敏先生,中信银行副行长,分管托管业务。杨先生自2015年7月起任本行党委委员,2015年12月起任本行副行长。此前,杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长;2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长;1982年8月至2006年6月在中国建设银行河南省分行工作,历任计财处副处长,信阳分行副行长、党委委员,计财处处长,郑州市铁道分行党委书记、行长,郑州分行党委书记、行长,河南省行党委副书记、副行长(主持工作)。杨先生为高级经济师,研究生学历,管理学博士。

杨先生,现任中信银行资产托管部总经理,硕士研究生学历,高级经济师,教授级注册税务师,先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行,1997年加入中信银行,担任任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长、总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理,中信银行贵阳分行党委书记、行长,总行行政管理部总经理,研究生学历,管理学博士。

2004年8月18日,中信银行经中国证监会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2018年6月末,中信银行已托管154只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模达到856.6亿元人民币。

## 三、相关服务机构

## (一)基金份额发售机构

## 1.直销机构:

(1)嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址:北京市东城区建国门内大街7号万安中心10层  
电话:(010) 65251688 传真:(010) 65251577  
联系人:赵佳

(2)嘉实基金管理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号上海国金中心二期33层09-11单元  
电话:(021) 38769696 传真:(021) 16898003  
联系人:邵璐

(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177号中融国际中心A座28楼1单元04-06单元  
电话:(028) 198262100 传真:(028) 198262100  
联系人:王碧玥

(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址:深圳市福田区福田街道福源1号太平金融大厦16层  
电话:(0755) 184832200 传真:(0755) 28879663  
联系人:陈静璇

(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址:青岛市市南区江西路6号华大国际B座1101室  
电话:(0632) 16677797 传真:(0632) 16677776  
联系人:胡晓媛

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址:杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城华润中心1001A室  
电话:(0571) 188901352 传真:(0571) 188765331  
联系人:王薇

(7)嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址:福州市鼓楼区五四路137号合辉广场901A单元  
电话:(0591) 188013670 传真:(0591) 188013670  
联系人:吴洋

(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288号新街口广场北侧4202室  
电话:(025) 166971118 传真:(025) 166971100  
联系人:徐静

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址:广州市天河区珠江东路6号广州国际金融中心606-06A单元  
电话:(020) 187554163 传真:(020) 181551221  
联系人:隋斌

## 2.代销机构

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

## (一)直销机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所、办公地址	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33层01-11单元
法定代表人	赵学军
联系人	邵璐
电话	(010) 16215628
传真	(010) 16518579

(二)出具法律意见书的律师事务所

名称	源启律师事务所
住所、办公地址	上海市浦东新区东南路260号华能大厦14楼
负责人	邵建
电话	(021) 15115038-856
传真	(021) 15115038
经办律师	刘佳、张兰

(三)出具基金财产的会计师事务所

名称	普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)
住所、办公地址	上海市浦东新区国家大道1号普华永道大厦9楼
负责人	李丹
电话	(021) 12323888
传真	(021) 12323888
经办注册会计师	薛晨、张勇

## 四、基金的名称

## 五、基金的类型

## 六、基金的投资目标

在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的稳健收益。

## 七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括:现金;期限在一年以内(含一年)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)的国债、非金融企业债券等固定收益资产;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。法律法规及监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场基金的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场基金的投资,本基金持有大会。如相关法律法规或监管机构日后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

1.资产配置策略  
根据宏观经济指标(主要包括:市场估值水平、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、领先指标、人民币利率水平、汇率等),决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布。

2.个券选择策略  
在个券选择上,本基金通过定性定量方法,综合考量收益率曲线、流动性、信用风险,评估个券投资价值,发掘具有具备相对优势的个券。

3.银行存款投资策略  
本基金根据不同银行的银行存款存款利率情况,结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析,以及对整体利率市场环境及其变动趋势的研究,在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值且流动性较好的存款。

4.利用市场机会的灵活策略  
由于市场波动、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡,新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡,这种失衡将带来一定市场机会,本基金通过分析短期市场机会发生的时间,研究其背后的规律,调整组合仓位配置,及时调整操作,并积极利用市场机会获取超额收益。

## 5.投资决策

(1) 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、微观经济运行状况,货币政策执行及财政政策执行情况,货币市场和证券市场状况;  
3) 分析师研究报告,制定具体资产配置和调整计划,为投资决策提供依据。

(2) 决策程序  
1) 投资决策委员会定期和不定召开议会议,根据基金投资目标和市场的判断决定基金的整体投资策略,审批并批准基金经理提出的资产配置方案重大投资决策。  
2) 执行研究部门或岗位对宏观经济尤其是利率走势等进行分析,提出分析报告。  
3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究部门提出的报告,并结合基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定具体资产配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。

(3) 交易部依据基金经理的指令,制定交易策略并执行交易。  
(4) 监察稽核部门负责监督基金的运作管理是否符合法律法规及基金合同和公司相关管理制度的规定,对投资组合的流动性风险、信用风险监控以及各种风险监控指标,对市场预期风险进行风险评估,对基金组合的风险进行评估,提交风险监控报告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款税后利率  
活期存款是具备最高流动性的存款,本基金期望通过科学严谨的管理,使本基金达到类似活期存款的流动性以及更富的收益,因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

如果今后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,本基金管理人可以在履行适当程序后变更业绩比较基准,调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前2日在中国证监会指定媒体上刊登公告,而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,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、基金投资运作报告

基金管理人的董事会及董事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。  
本基金托管人中信银行资产托管部根据本基金基金合同约定,于2018年10月23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。本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日,本报告期末无未兑付资产。

## 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	固定收益资产	9,444,001,403.77	36.02
	其中:债券	9,379,477,403.77	36.77
	资产支持证券	65,124,000.00	0.25
2	货币资金	3,381,983,356.49	12.90
	其中:结算备付金	-	-
	银行存款	13,186,614,506.60	50.29
	其他	209,729,410.28	0.80
3	合计	26,222,229,138.24	100.00

## 2、报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	83.0
	其中:买断式回购融资	-
	其中:买断式回购融资余额	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,715,796,226.38	7.01

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例仍为报告期内每日融资余额占基金资产净值的简单平均值。(2)报告期内

内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

## 3、基金投资组合平均剩余期限

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

## (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	20.89	7.01
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
2	30天(含)-60天	11.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
3	60天(含)-90天	20.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
4	90天(含)-120天	5.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
5	120天(含)-397天(含)	47.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
	合计	106.21	7.01

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过240天。

## 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)	占基金资产净值比例(%)
1	国债资产	307,634,653.76	1.26
2	金融债券	971,542,236.69	3.97
	其中:政策性金融债	971,542,236.69	3.97
3	企业债券	1,767,069,306.27	7.21
4	同业存单	6,333,241,107.26	25.86
5	其他	-	-
6	其他	-	-
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,379,477,403.77	38.30
10	报告期内债券回购融资余额	-	-

注:上表中,附息债券的成本包括摊余价值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收益。

## 6、报告期末按摊余成本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	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	111801218	18国债(零)	11,000,000	1,094,972,804.81	4.43
2	111818179	18国债(零)	10,000,000	990,400,182.66	4.04
3	011800908	18广中烟	7,000,000	703,620,145.21	2.87
4	111816236	18广中烟	6,000,000	688,562,162.57	2.86
5	111818177	18国债(零)	6,000,000	594,248,812.93	2.43
6	111883466	18北农发债	5,000,000	497,763,115.56	2.03
7	111816281	18广中烟	5,000,000	497,250,881.31	2.03
8	11183497	18广中烟	4,000,000	493,082,644.44	2.01
9	111821276	18广中烟	4,000,000	398,141,823.32	1.63
10	111818182	18国债(零)	4,000,000	396,156,322.64	1.62