

# 中金金利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第1号)

基金管理人:中金基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
二〇一九年一月

重要提示  
中金金利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请于2016年11月14日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2662号《关于准予中金金利债券型证券投资基金注册的批复》注册,并于2016年12月13日经中国证监会证券投资基金部函[2016]3163号《关于中金金利债券型证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2016年12月13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投资价值、收益及市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

中金金利债券型证券投资基金投资于证券及期货市场,基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作及技术风险、合规性风险。本基金特有风险,税负增加风险和其他风险等。本基金投资品种包含中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发生主体信用恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和本基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。  
本基金基金份额分为A、C两类,其中A类基金份额收取申购/申购费,不计提销售服务费;C类基金份额不收取申购/申购费,但计提销售服务费;A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

投资有风险,投资人在申购/认购本基金时应认真阅读本招募说明书及其摘要。  
基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
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。本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2018年12月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日(财务数据未经审计)。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况  
名称:中金基金管理有限公司  
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层06室  
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层  
法定代表人:孙晋(代履职)  
成立时间:2014年2月10日  
批准设立机关:中国证券监督管理委员会  
批准设立文号:中国证监会证监许可[2014]97号  
组织形式:有限责任公司  
注册资本:3亿元人民币  
存续期间:持续经营  
联系人:张显  
联系电话:010-63211122  
公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员  
孙晋女士,董事长(代履职),管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理,公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及人事等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。  
黄劲峰先生,董事,机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所(英国及香港)审计、核算见习生、副经理、经理等职务;香港汇丰银行资本市场部投资经理、货币及外汇市场财务经理职务;高盛(亚洲)、高盛集团(日本东京)固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务;北京国华证券有限责任公司中后台协调、运营管理岗位;高盛(亚洲)有限责任公司资产管理部亚太区首席副经理、亚太(除日本)首席运营官、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、董事总经理。

陈刚先生,董事,法学博士。历任国务院发展研究中心技术经济研究所研究员;北京东森律师事务所律师;中国国际金融(中国)有限公司合规律师、中国国际金融(香港)有限公司合规律师、中金美国证券有限公司法律部负责人;厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈刚先生是纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

赵壁先生,董事,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资管理银行部经理、中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。

李永先生,董事,工商管理硕士。历任中国人保资产管理股份有限公司交易员、风险监控员、投资经理;中国人寿资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益部投资经理、高级投资经理、一级团队负责人;中国人寿资产管理有限公司固定收益委员会委员、自有资金投资委员会委员。现任中金基金管理有限公司副总经理。

张春先生,独立董事,经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学东北森管理学院金融系终身教授;中欧国际工商学院金融及会计系副教授、系主任、副教授长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

顾丽女士,独立董事,经济法学硕士、EMBA硕士。历任云南政法干部管理学院教师;四通集团法务部法律事务部副主任;海内律师事务所律师、嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合伙人。

曹大卫,独立董事,哲学博士。历任北京大学光华管理学院团委副书记、党委副书记、党委书记,北京大学医学部副主任、财务部部长,北京大学副总会计师等职务。现任神州泰岳软件股份有限公司董事。

2.基金管理人监事  
夏静女士,执行监事,理学硕士。历任普华永道(深圳)咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制部副经理;中国国际金融股份有限公司公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部负责人。

3.基金管理人高级管理人员  
孙晋女士,董事长(代履职),总经理。简历同上。  
李永先生,副总经理。工商管理硕士,简历同上。  
汤映女士,硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理,华安基金管理有限公司零售业务部副总经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。

李虹女士,督察长,法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表律师;中国国际金融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

4.本基金基金经理  
石玉女士,管理学硕士。历任天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员;中国国际金融股份有限公司高级研究员、投资经理助理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

5.投资决策委员会成员  
李永先生,工商管理硕士。简历同上。  
王雁来先生,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部行业研究员,定向资产管理业务投资经理,集合资产管理计划投资经理。现任中金基金管理有限公司权益投资负责人、专户投资部总经理、投资经理。

郭钰钰先生,工商管理硕士。历任宁波炼化石化投资经理;华泰证券项目经理,德恒证券高级经理;华策投资有限公司投资副总经理;招商基金管理有限公司高级投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

石玉女士,管理学硕士。简历同上。  
朱宝臣先生,理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部执行总经理,量化投资总监;现任中金基金管理有限公司量化投资部执行总经理,量化投资部负责人。

杨立先生,经济学硕士。历任民生证券股份有限公司证券投资助理,证券基金投资,华融证券股份有限公司中高级投资经理,高级投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部副总经理。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人  
名称:中国工商银行股份有限公司  
注册地址:北京西城区复兴门内大街55号  
成立时间:1984年1月1日  
法定代表人:易会满  
注册资本:人民币35,640,625.71万元  
联系电话:010-61010579  
联系人:郭明

(二)主要人员情况  
截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大专以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况  
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内、外广大投资者、金融资产管理机构和企事业单位提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产

品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金674只。自2003年以来,本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等海内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构  
1.直销机构  
(1)直销柜台  
名称:中金基金管理有限公司  
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层06室  
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层  
法定代表人:孙晋(代履职)  
电话:010-63211122  
传真:010-66159121  
联系人:张显  
客户服务电话:400-888-1166  
网站:www.ciccfund.com  
(2)网上直销  
交易系统:中金基金网上交易系统  
交易系统网址:trade.ciccfund.com  
2.其他销售机构  
(1)中国中投证券有限责任公司  
客服电话:05532  
网站:http://www.china-invscn/

(2)上海联泰资产管理有限公司  
客服电话:021-52822063  
网站:http://www.66zichan.com/

(3)平安证券有限责任公司  
客服电话:95511  
网站:http://stock.pingan.com

(4)上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号  
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室  
法定代表人:杨文斌  
联系人:张达  
电话:021-20613999  
传真:021-68598919  
客服电话:400-700-9665  
网站:www.ehowbuy.com

(5)上海得得投资管理有限公司  
客服电话:400-821-0203  
网站:www.520fund.com.cn

(6)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司  
客服电话:4000-766-123  
网站:www.fund123.cn

(7)上海海享投资管理有限公司  
客服电话:021-33356675  
网站:http://www.luxdfund.com/

(8)长城证券股份有限公司  
客服电话:400-6666-888  
网站:http://www.cgws.com/

(9)中国国际金融股份有限公司  
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及26层  
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及26层  
法定代表人:孙晋(代履职)  
电话:010-65051166  
传真:010-65058065  
联系人:杨旌宇  
网站:www.cicc.com.cn

(10)银河证券股份有限公司  
客服电话:95551  
网站:http://www.chinastock.com.cn/

(11)北京肯特财富投资管理有限公司  
客服电话:400-098-8511  
网站:http://kjfd.jd.com/index.html

(12)上海基煜基金销售有限公司  
客服电话:400-820-5369  
网站:www.jiyufund.com

(13)包商银行股份有限公司  
客服电话:96352  
网站:www.bsh.com.cn

(14)和讯信息科技有限公司  
客服电话:400-920-0022  
网站:licaike.hexun.com

(15)北京蛋卷基金销售有限公司  
客服电话:400-061-8518  
网站:https://danjuanapp.com/

(16)上海天天基金销售有限公司  
客服电话:400-931-9310  
网站:http://fund.eastmoney.com/

(17)上海挖财金融信息服务有限公司  
客服电话:021-50871073  
网站:http://www.wacai.com/

(18)通华财富(上海)基金销售有限公司  
客服电话:96156495  
网站:https://www.tonghuafund.com/

(19)洪泰财富(青岛)基金销售有限公司  
客服电话:400706863  
网站:www.hongtaiwealth.com

(20)北京鼎诚汇华投资咨询有限公司  
客服电话:4008199868  
网站:www.tdyhfund.com

(21)北京恒天明泽基金销售有限公司  
客服电话:400-898-0618  
网站:http://www.chtfund.com

(22)北京植信基金销售有限公司  
客服电话:010-56075718  
网站:www.zhixin-inv.com

(23)南京苏宁基金销售有限公司  
客服电话:06177  
网站:www.snjijin.com

(24)浙江同花顺基金销售有限公司  
客服电话:4008-773-772  
网站:www.5ifund.com

(25)渤海银行股份有限公司  
客服电话:95541  
网站:www.cbhb.com.cn

(26)济安财富(北京)基金销售有限公司  
客服电话:400-673-7010  
网站:http://www.jianfortune.com/

(27)泰诚财富基金销售(大连)有限公司  
网站:www.taichengcaifu.com  
电话:400-0411-001

(28)中信建投证券股份有限公司  
网站:www.csc108.com  
电话:4008-888-108

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构公告。

(二)登记机构  
名称:中金基金管理有限公司  
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层06室  
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层  
法定代表人:孙晋(代履职)  
电话:010-63211122  
传真:010-66155573  
联系人:白嫚

(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海市通力律师事务所  
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人:俞卫华  
电话:021-31358666  
传真:021-31358600  
联系人:安冬、陆奇  
经办律师:安冬、陆奇

(四)审计基金财产的会计师事务所  
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层  
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层  
执行事务合伙人:邹广  
电话:010-85185111  
盖章注册会计师:程海良、李砾  
联系人:管梓铭

## 四、基金名称

中金金利债券型证券投资基金

### 五、基金的类型与运作方式

(一)基金的类型  
债券型证券投资基金

(二)基金的运作方式  
契约开放式

在严格控制风险和保持流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳定的增值。

### 六、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行

票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分,不可转股)、可交换债券(不可转股)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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相关规定)。

本基金不投资股票、权证等权益类资产。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的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交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 八、基金的投资策略

(一)资产配置策略  
本基金为债券型基金,不直接从二级市场买入股票,也不参与一级市场新股申购或增发新股。本基金的资产配置策略主要是基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究,结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的综合评估,在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。

(二)普通债券投资策略  
1.债券类属配置策略  
本基金将通过研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系,分析国债、金融债、企业债、短融和中票票据等不同债券品种之间的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例并根据市场变化进行调整。

2.期限结构配置策略  
本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下,确定最佳的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略等。

3.利率策略  
本基金通过对经济运行状况、分析宏观经济运行可能情景的研判,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金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。组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可制定组合组合的目标久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,以减小债券价格下降带来的风险。

4.信用债投资策略  
本基金将通过自下而上的策略,在信用类固定收益金融工具中精选个券,结合适度分散的行业配置策略,构造并优化投资组合。

(1)买入并持有策略  
买入并持有策略是指选择信用风险可承担,期限与收益率相对合理的信用类产品持有到期,获取息票收入。选择买入并持有策略时,基金债券的原则包括:

1)债券的信用风险可承担。通过对债券的信用风险和收益进行分析,选择收益率较高,信用风险可承担的债券品种。

2)债券的信用利用合理。债券信用利差有明显的周期变化,本基金可在信用利差较高并有减小趋势的情况下,加大买入并持有策略的力度。

3)债券的期限合理。根据利率市场的波动性,在相对高利率环境下,选择期限较长的品种,在相对低利率环境下,选择期限较短的品种。

(2)行业配置策略  
基于对大的宏观信用环境、行业发展趋势等基本而研究,本基金将运用定性定量模型,在自下而上的个债精选策略基础上,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)利率滚动策略  
信用债券的利率将受到经济周期、行业周期等因素的影响具有周期性变化的特征,本基金将结合对经济周期和行业周期的判断,在预期利差将变大的情况下卖出此类债券,在预期利差缩小的情况下买入此类债券,以获取利息收益。

5.骑乘策略  
骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,本基金将适当买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,即收益率水平处于相对高位的时候,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将缩短,而此时期债券的收益率水平将会较投资初期有所下降,通过债券收益率的提升,从而获得资本利得收益。

6.息差策略  
息差策略是指利用回购等方式融入低成本资金,购买较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。

(三)中小企业私募债券投资策略  
对于单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金会加强自下而上的分析,将机构评级与主体评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

(四)可转换债券投资策略  
在分析宏观经济运行特征并对各类市场走势做出判断的前提下,本基金对可转换债券所对应的基础股票进行分析和研究,从行业选择和个股选择两方面进行全方位的评估,对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注,对可转债投资价值进行有效的评估,选择投资价值较高的个券进行投资。

(五)可交换债券投资策略  
可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值,本基金管理人将对可交换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值可交换债券进行投资。此外,本基金还将根据新发可交换债券的预计中签率、模型定价结果,积极参与可交换债券新券的申购。

(六)资产支持证券投资策略  
本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展,将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产支持证券所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,制定周密的投资策略。在具体投资过程中,重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型,提前预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的投资规模,选择风险调整后收益高的品种进行投资,实现资产支持证券对基金资产的最优贡献。

(七)国债期货投资策略  
本基金投资国债期货以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

九、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率。

中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制,该指数旨在综合反映债券市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场交易场所市场,具有广泛的市场代表性。基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制该指数,或今后法律法规发生变化或更改指数名称,或有更适当的、更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,经履行适当程序,调整业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征  
本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

十一、基金投资组合报告  
基金管理人董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定,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,报告期间为2018年7月1日至2018年9月30日。本报告数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	-	-
1.1	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	201,067,774.30	96.41
3.1	其中:债券	201,067,774.30	96.41
3.2	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	-	-
6.1	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,584,744.14	2.77
8	其他资产	3,828,188.04	1.82
9	合计	210,740,676.48	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合  
(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合  
本基金本报告期末未持有股票资产。

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票资产。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末持有股票投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债期货	122,274.30	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	74,727,000.00	44.43
3.1	其中:政策性金融债	74,727,000.00	44.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	126,215,600.00	76.86
6	中期票据(可交易)	-	-
7	国债回购	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	合计	201,067,774.30	113.64

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债期货	122,274.30	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	74,727,000.00	44.43
3.1	其中:政策性金融债	74,727,000.00	44.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	126,215,600.00	76.86
6	中期票据(可交易)	-	-
7	国债回购	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	合计	201,067,774.30	113.64

6.报告期末前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证投资。

9.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

11.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

12.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

13.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

14.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

15.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

16.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

17.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

18.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

19.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

20.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。