

# 建信现金增利货币市场基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1号

基金管理人:交通银行股份有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
二〇一九年三月

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]3076号文注册募集。本基金的基金合同于2016年7月26日正式生效。

基金管理人保证本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、市场前景和收益等作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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,由于基金份额持有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积极管理风险,本基金的特有风险等。本基金为货币市场基金,其风险和预期收益低于股票基金、混合基金和债券基金。投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和基金产品特性,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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年1月25日,有关财务数据和净值表现截止日已为2018年12月31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

(一)基金管理人概况  
名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

设立日期:2005年9月19日  
法定代表人:孙志晨  
联系人:郭雅莉  
电话:010-66228888  
注册资本:人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:中国建设银行股份有限公司,65%;美国信安金融服务公司,25%;中国华电集团资本控股有限公司,10%。

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利,不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职尽责情况。

(二)主要人员情况  
1、董事会成员  
孙志晨先生,董事长,1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长,中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。2005年9月出任建信基金公司总裁,2018年4月起任建信基金公司董事长。

张军红先生,董事,现任建信基金公司总裁。毕业于国家行政学院行政管理专业,获博士学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员;零售业务部主任科员;个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理;行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理;投资托管服务部总经理助理、副总经理;投资托管业务部副总经理;资产托管业务部副总经理。2017年3月出任公司监事会主席,2018年4月起任建信基金公司总裁。

曹伟先生,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生,董事,现任信安亚洲区总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学及复旦大学EMBA工商管理学硕士学位。历任新加坡公共服务委员会副处长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和代总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事,信安北亚地区副总裁、总裁。

郑树明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席运营官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理,新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长,爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场销售总监。

华薇女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学,获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监,锦辉控股集团子公司副总裁,锦辉精细化工有限公司总经理,吉林省信托有限责任公司业务七部副经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理,光大证券财富管理中心的总经理(MD)。

李金先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1988年毕业于中国人民大学研究生部,历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理,博时基金管理有限公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

史亚萍女士,独立董事,现任嘉浩控股有限公司首席运营官。1994年毕业于对外经济贸易大学,获国际金融学硕士学位;1996年毕业于耶鲁大学研究生院,获经济学硕士学位。先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理、中金资本等多家金融机构担任管理职务。

邱靖之先生,独立董事,现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业,获EMBA学位,全国会计领军人才,中国注册会计师,注册资产评估师,高级会计师,澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所,现任首席合伙人。

2、监事会成员  
马美芹女士,监事会主席,高级经济师,1984年毕业于中央财政金融学院,获学士学位,2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士。1984年加入建设银行,历任总行筹资部、零售业务部、个人银行部副处长、处长、资深客户经理(技术二级),个人金融部副经理,个人存款与投资部副经理。2018年5月起任建信基金公司监事会主席。

方贻敏女士,监事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限公司机构与战略部总经理。1992年毕业于北京工

业大学工业会计专业学士,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中瑞华恒信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部助理经理、副经理,中国华电集团资本控股(华电财务公司)计划财务部经理,中国华电集团财务有限公司财务部经理,中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

安晓先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监兼信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系,获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部,中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理,代处长,建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理,信息技术部执行总经理、总经理。

严冰女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司,历任人力资源部主管、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司内控合规部副总经理兼内控合规部审计部(二级部)总经理,英国特许公认会计师公会(ACCA)资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司内控合规部。

## 3、公司高管人员

张军红先生,总裁(简历请参见董事会成员)  
曹冀先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员、重组改制办公室高级副经理、行长办公室高级副经理,2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理。2015年8月6日起任我公司副总裁,2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理,2017年11月30日至2018年11月1日兼任建信资本管理公司董事长。

张薇薇先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券投资基金销售业务,任高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴黎明先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行,先后在总行营业部、金融科技部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入建信基金管理公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长,2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玖女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

马勇先生,副总裁,硕士。1993年8月至1995年8月在江苏省机械研究设计院工作。1998年7月加入中国建设银行总行,历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书,高端客户部总经理助理,财富管理私人银行部总经理助理、副总经理,建行黑龙江省分行副行长等职务。2018年8月30日加入建信基金管理有限责任公司,2018年11月13日起任副总裁;2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事长。

4、督察长  
吴黎明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)  
5、基金经理  
陈国良先生,双学士学位,固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理,2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉新货币市场基金的基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理;2016年3月14日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理,该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金,陈国良继续担任该基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2016年9月13日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。

先轸宇先生,硕士。2009年7月至2016年5月在中国建设银行金融市场部工作,曾从事绩效管理,2012年起任债券交易员。2016年7月加入我公司,历任固定收益投资部基金经理助理、基金经理,2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2018年3月26日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;自2019年1月25日起任建信天添益货币市场基金、建信嘉新货币市场基金、建信货币市场基金的基金经理。

历任基金经理:  
高蕾女士:2016年7月26日至2018年4月2日。  
陈建良先生:2016年7月26日至今。

先轸宇先生:2017年7月7日至至今。  
6、投资决策委员会成员  
张军红先生,总裁。  
姚锦女士,权益投资部总经理。

李青女士,固定收益投资部总经理。  
乔梁先生,研究部总经理。  
许杰先生,权益投资部副总经理。  
朱虹女士,固定收益投资部副总经理。  
陶灿先生,权益投资部总经理助理。  
7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2017年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第11位,较上年上升2位;根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强企业排行榜,交通银行营业收入位列第171位。

截至2018年9月30日,交通银行资产总额为人民币93915.37亿元。2018年1—9月,交通银行实现净利润归属于母公司股东)人民币573.04亿元。  
交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中

心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## (二)主要人员情况

彭纯先生,董事长、执行董事,高级会计师。  
彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月起任本行执行董事,2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事,2013年10月至2018年1月任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民大学研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生,副董事长、执行董事、行长,高级经济师。  
任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长。2014年7月至2016年11月任中国银行副行长,2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长,其中:2015年10月至2018年6月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事,2016年9月至2018年6月兼任中国银行股份有限公司总行交易业务部总经理;2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险管理部总经理、授信管理部总经理、湖北分行行长、风险管理部总经理;1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行、中国建设银行风险管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年毕业于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁,高级经济师。  
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

## (三)基金托管业务经营情况

截至2018年9月30日,交通银行共托管证券投资基金384只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、OFII证券投资基金、RQFII证券投资基金、QDII证券投资资产、RODII证券投资基金和ODLI资金等产品。

## 三、相关服务机构

### (一)基金份额发售机构

1、直销机构  
本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台。  
(1)直销柜台名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人:孙志晨  
联系人:郭雅莉  
电话:010-66228800

2、代销机构  
(1)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

法定代表人:陈柏青  
客户服务电话:4000766123  
网址:www.fund123.cn

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)基金份额登记机构  
名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
法定代表人:孙志晨  
联系人:郑文广  
电话:010-66228888  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:北京德恒律师事务所  
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
负责人:王丽  
电话:刘焕志、孙艳利  
电话:010-52682888  
传真:010-52682999  
经办律师:刘焕志、孙艳利

(四)审计基金资产的会计师事务所  
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼  
电话:021-2322 8888

执行事务合伙人:李丹

经办注册会计师:许康伟、沈兆杰

联系人:沈兆杰

## 四、基金的名称

建信现金增利货币市场基金。

## 五、基金的类型

货币市场基金。

## 六、基金的投资目标

在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现稳定的、超越业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资方向

本基金将投资于下列金融工具:

1、现金;  
2、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;  
3、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具;  
4、法律法规或中国证监会、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。

本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的,应当经基金管理人董事会审议批准,相关交易应当事先征得基金托管人的同意,并作为重大事项履行信息披露程序。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金将采取个券选择策略、利率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、资产配置策略  
基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征,决定基金资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。

2、个券选择策略  
在个券选择上,基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。

3、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。

4、利用短期市场机会的灵活策略  
由于市场分割、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期的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税前)。  
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。

若未来市场发生变化导致业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示,报中国证监会备案。

## 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、基金的投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17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。

本报告投资组合报告所载数据截至2018年12月31日止,本报告中财务资料未经审计。

### 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	固定收益投资	51,044,004.34174	61.18
	其中:债券	50,752,246,407.99	50.88
	资产支持证券	291,757,593.75	0.29
2	买入返售金融资产	13,747,964,373.04	13.78
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	34,518,061,277.53	34.61
4	其他资产	433,317,419.82	0.43
5	合计	99,743,337,412.13	100.00

### 2、报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	10.64
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	4,302,113,336.07	4.59
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日债券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  
本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

### 3、基金投资组合平均剩余期限

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	115
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	93

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明  
本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过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	各期限负债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	15.88	6.36
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-90天	9.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	90天(含)-180天	32.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	180天(含)-1260天	10.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	1260天(含)-397天(含)	37.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计	106.94	6.36	-

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明  
本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过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)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	500,044,958.69	0.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,284,188,365.18	4.57
	其中:政策性金融债	4,284,188,365.18	4.57
4	企业债券	588,969,537.89	0.64
5	企业短期融资券	9,779,632,385.12	10.43
6	中期票据	241,756,798.14	0.26
7	同业存单	35,347,653,473.07	37.71
8	其他	-	-
9	合计	50,752,246,407.99	54.14
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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)	占基金资产净值的比例(%)
1	111889057	18北京农村商业银行CD092	10,000,000	986,017,042.09	1.06
2	111810105	18兴业银行FJCD065	10,000,000	980,217,163.66	1.05
3	111872583	18晋商银行CD234	10,000,000	963,434,622.21	1.03
4	180407	18农发07	8,900,000	890,094,627.01	0.95
5	160208	16国开08	7,400,000	738,283,006.35	0.79
6	11184896	18甘肃银行FJCD105	7,000,000	695,423,950.07	0.74
7	111887264	18北京农村商业银行CD085	7,000,000	692,755,870.84	0.74
8	11187211	18招商银行CD200	7,000,000	688,778,196.77	0.73
9	11188545	18广汇银行CD098	7,000,000	688,425,149.99	0.73
10	11187131	18天津银行FJCD360	7,000,000	682,908,155.99	0.73

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%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1467%
报告期内偏离度的最低值	-0.0229%
报告期内每个工作日偏离度的简单平均值	0.1121%

(1)报告期内偏离度的绝对值达到0.25%情况说明  
报告期内偏离度的绝对值未达到0.25%。  
(2)报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明  
报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

报告期内未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的

前十名资产支持证券投资明细

序号	债券
----	----