

交银施罗德活期货币基金(更新) 招募说明书摘要

(2019年第1号)

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中信建投证券股份有限公司
二〇一九年一月

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

交银施罗德活期货币市场基金(以下简称“本基金”)经2016年7月12日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】1570号文准予募集注册。本基金基金合同于2016年7月27日正式生效。

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价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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。投资人在投资本基金前,需全面了解本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意见、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持份额享受本基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的风险;基金管理人及基金管理人所在机构在基金募集过程中产生的法律风险;流动性风险;交易对手违约风险;投资证券市场基金特有的其他风险等等。本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

本基金投资于货币市场工具,面临货币市场利率波动的风险,基金每日的收益将根据市场情况下波动,在极端情况下可能为负值。由于货币市场基金的特殊要求,为满足投资者的赎回需要,基金必须保持一定的现金比例以应对赎回的需求,在管理现金头寸时,有可能存在现金不足的风险或现金过多带来的机会成本风险。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到0.5%时,基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日后将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。故投资者可能面临暂停申购的风险。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时,基金管理人应当采用公允价值估值方法进行持有基金份额的账面价值进行调整,或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施,故投资者可能面临上述估值调整或暂停赎回及基金合同提前终止的风险。

在满足相关流动性风险管理要求的前提下,当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值比例合计低于5%且偏离度为负时,当单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的,该基金份额持有人可能面临被征收1%的强制赎回费用的风险。上述赎回费用全额计入基金财产;当本基金前10名基金份额持有人的持有基金份额合计超过基金总份额50%、且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值比例合计低于10%且偏离度为负时,基金管理人应当对当日单个基金份额持有人超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金财产,故投资者可能面临上述被征收1%的强制赎回费用的风险。此外,单个基金份额持有人存在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额10%的,该基金份额持有人有可能面临部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的风险。

投资者购买本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,也不能保证最低收益。

投资有风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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前,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,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。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人应仔细阅读并透彻理解基金合同,并就基金合同持有者和本基金合同的当事人,持有其基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按《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。基金投资者应充分了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书书所截止日为2019年1月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大厦二楼(裙)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
邮政编码:200120
法定代表人:阮红
成立时间:2006年8月4日
注册资本:2亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:郭佳敏
电话:(021)61065005
传真:(021)61065004
交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监基金字[2006]28号文批准设立,公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	60%
摩根大通银行有限公司	30%
中国国际金融有限公司(以下简称“中银国际”)	10%

(二)主要成员情况

1.基金管理人董事会成员
阮红女士,董事长,博士学位。历任交通银行办公室副处长、处长,交通银行海外机构管理部副总经理、总经理,交通银行上海分行副行长,交通银行资产托管部总经理,交通银行投资管理部总经理,交银施罗德基金管理有限公司总经理。
陈朝灯先生,副董事长,博士学位。现任施罗德证券投资信托股份有限公司投资总监兼专户管理部主管。历任复华证券投资信托股份有限公司专户投资经理,景顺证券投资信托股份有限公司部门主管、投资总监。
周曦女士,董事,硕士学位。现任交通银行总行个人金融业务部副总经理兼风险管理部副总经理。历任交通银行湖南省分行风险管理部、资产保全部、法律合规部、个人金融业务部总经理,交通银行总行个人金融业务部总经理助理。
孙荣俊先生,董事,硕士学位。现任交通银行总行风险管理部(资产保全部)副总经理。历任交通银行总行风险管理部高级经理、高级经理,交通银行广西柳州分行行长、交通银行内蒙古区分行行长助理。
李定邦(LievenDebruyne)先生,董事,硕士学位。现任施罗德集团亚太区行政总裁。历任施罗德投资管理有限公司亚洲投资产品总监,施罗德投资管理(香港)有限公司行政总裁兼亚太区基金业务拓展总监。
郝爱群女士,独立董事,学士学位。历任民生银行稽核部副处长、处长,合作司调研员,非银行副巡视员,副司长;银监会非银部副主任,银行监管一部副主任、巡视员;汇金公司派出董事。

张宇学先生,独立董事,博士学位。现任中国政法大学民商经济法学院教授,兼任基金业协会自律监察委员会委员,历任证监会办公厅副处长、上市公司监管部处长,行政处罚委员会专职委员,副主任审理员,兼任证监会上市公司并购重组审核委员会委员、行政处罚委员会副主任。
黎建强先生,独立董事,博士学位,教育背景长江学者讲座教授。现任香港大学工业工程系荣誉教授,亚洲风险及危机管理协会主席,兼任上交所上市的中联重科集团独立非执行董事。历任香港城市大学管理科学讲座教授,湖南省政协委员并兼任湖南大学工商管理学院院长。

2.基金管理人监事会成员

王忆军先生,监事长,硕士学位。现任交通银行战略投资部总经理。历任交通银行办公室副处长,交通银行公司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理,交通银行投资银行部副总经理,交通银行江苏分行副行长。
章晓娟女士,监事,硕士学位,注册会计师,美国特许金融分析师(CFA)持证。现任施罗德投资管理(香港)有限公司亚洲投资风险主管,历任法国安盛投资管理(香港)有限公司亚洲风险管理、华安兴业基金管理有限公司风险管理部总经理,渣打银行(香港)交易风险风控等职。

张玲女士,监事,学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司市场总监。历任中国银行股份有限公司,新华人寿保险股份有限公司上海分公司区域经理,银河基金管理有限公司市场部渠道经理,交银施罗德基金管理有限公司渠道经理,渠道部副经理、广州分公司副总经理、营销管理部总经理。

刘峥先生,监事,硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司总裁办公室副总经理。历任交通银行上海市分行管理培训生、交通银行总行战略管理部高级投资并购经理,交银施罗德基金管理有限公司总裁办公室高级综合管理经理。

3.基金管理人高级管理人员

阮红女士,总经理。简历同上。
许娜燕女士,副总经理,硕士学位,高级经济师,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司国债部副经理,基金管理部总经理,湘财期货银基金管理有限公司总经理。
夏华龙先生,副总经理,博士学位。历任中国地质大学经济管理系教师,经济学院教研室主任、经济学院院长;交通银行资产托管部副行长、处长、高级经理、副总经理;交通银行资产托管业务中心副总裁;云南省曲靖市市委常委、副市长(挂职)。
谢卫先生,副总经理,经济学博士,高级经济师。历任中央财经大学金融系教师;中国社会科学院财所助理研究员;中国电力信托投资公司证券总部副经理,中国人保信托投资公司证券部副经理、总经理,北京证券营业部总经理、基金总部副经理兼北方部总经理,富国基金管理有限公司副经理。
田晓女士,副总经理,上海财经大学工商管理硕士,历任交通银行研究开发部副主管体规划组,交通银行市场营销部副主管市场规划组、主管市场规划组,交通银行公司业务部副高级经理、高级经理,交通银行机构业务部高级经理、总经理助理、副总经理。
余川女士,督察长,硕士学历。历任华泰证券有限责任公司综合发展部高级经理,投资银行部项目经理,银河基金管理有限公司监察部总监,交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理、监察风控副总监、投资运营总监。

4.本基金基金经理

黄莹洁女士,香港大学工商管理硕士、北京大学经济学、管理学双学士。11年证券投资行业从业经验。2008年2月至2012年5月任中海基金管理有限公司交易员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任中央交易室交易员。自2015年7月25日至2018年3月18日担任交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金基金经理。自2015年5月27日起担任交银施罗德货币市场证券投资基金基金经理至今,自2015年5月27日起担任交银施罗德天益货币市场基金基金经理至今,自2015年7月25日起担任交银施罗德丰享收益债券型证券投资基金基金经理至今,自2015年12月20日起担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金基金经理至今,自2016年7月27日起担任交银施罗德活期货币市场基金基金经理至今,自2016年10月19日起担任交银施罗德天利货币市场基金基金经理至今,自2016年11月28日起担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金基金经理至今,自2016年12月7日起担任交银施罗德天鑫货币市场基金基金经理至今,自2017年3月3日起担任交银施罗德瑞尚收益债券型证券投资基金基金经理至今。

连端清先生,复旦大学经济学博士。10年证券投资相关从业经验。2009年至2011年于交通银行总行金融市场部任职,2011年至2013年任湘财证券研究所研究员,2013年至2015年任中国信托资产管理部投资经理。2015年加入交银施罗德基金管理有限公司,2017年3月31日至2018年8月23日担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金基金经理,2015年8月4日起担任交银施罗德丰盈收益债券型证券投资基金、交银施罗德现金宝货币市场基金、交银施罗德丰泽收益债券型证券投资基金的基金经理至今,2015年10月16日起担任交银施罗德货币市场证券投资基金、交银施罗德理财60天债券型证券投资基金基金经理

理至今,2016年7月27日起担任交银施罗德活期货币市场基金基金经理至今,2016年10月19日起担任交银施罗德天利货币市场基金基金经理至今,2016年11月28日起担任交银施罗德裕隆纯债债券型证券投资基金基金经理至今,2016年12月7日起担任交银施罗德天鑫货币市场基金基金经理至今,2017年3月3日起担任交银施罗德瑞尚收益债券型证券投资基金基金经理至今,2017年3月31日起担任交银施罗德裕盈纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕利纯债债券型证券投资基金基金经理至今,2017年12月29日起担任交银施罗德天运货币市场基金基金经理至今。

5. 投资决策委员会成员
委员:阮红(总经理)
王少成(权益投资总监、基金经理)
于海顺(固定收益(公募)投资总监、基金经理)
马晓(研究总监)
上述人员之间不存在近亲属关系。上述各委员信息更新截止日为2019年1月27日,期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况
名称:中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
成立时间:2005年11月2日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币76.46亿元
批准设立机关和批准设立文号:中国证监会证监机构字[2005]111号
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2015]210号
联系人:谢川华
电话:(010)85159352

中信建投证券成立于2005年11月2日,是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司。公司注册于北京,注册资本76.46亿元,并设有中信建投期货有限公司,中信建投证券有限公司,中信建投(国际)金融控股有限公司,中信建投基金管理有限公司等4家子公司。自成立以来,中信建投证券各项业务快速发展,在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券基金、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势,并搭建了研究咨询、信息技术、运营及行生产运营等综合管理、合规管理等专业化支持体系。凭借高度的敬业精神和突出的专业能力,中信建投证券主要业务指标及盈利能力目前均位居行业前列。

(二)主要人员情况

中信建投证券投资托管管理团队和业务骨干具有丰富的证券投资基金托管业务运作经验,业务人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各个领域,可为托管客户提供个性化产品化处理服务。

(三)基金托管业务经营情况

中信建投证券于2015年2月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格,中信建投证券始终遵循“诚信、专注、成长、共赢”的经营理念,不断加强风险管理内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护基金份额持有人的合法权益,为基金份额持有人提供高质量的托管服务。

(四)托管业务的内部控制制度

1. 内部控制目标
严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度,防范和化解基金托管业务经营风险,确保托管资产的完整和安全,切实保护基金份额持有人权益,确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定,查错防弊,堵塞漏洞,消除隐患,保证托管业务安全、有效、稳健运行。

2. 内部控制组织结构

中信建投证券设有风险管理委员会,负责全公司风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部控制稽核岗,配备专职稽核稽核人员,在托管部行政负责人的直接领导下,依照有关法律法规,对业务的运行独立行使监督稽核职权。

3. 内部控制制度和措施

中信建投证券托管部建立了各项管理制度和操作规程,建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,保障托管业务健全、有效执行;安全保管基金财产,保持基金财产的独立性;实行经营场所封闭式管理,并配备录音和录像监控系统;有独立的综合托管服务系统;业务管理实行复核和检查机制,建立了严格有效的制衡体系;托管部树立内控优先和风险管理的理念,培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

(五)基金托管人与基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1. 监督方法
基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督,并及时提示基金管理人违规风险。

2. 监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和托管协议的约定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权利对相关资料事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人未按规定对基金托管人的违规事项未能在规定期限内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1. 直销机构
本基金直销机构仅为本基金管理人直销柜台。
机构名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大厦二楼(裙)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
法定代表人:阮红
成立时间:2006年8月4日
电话:(021)61065274
传真:(021)61065204
联系人:傅翰
客户服务电话:400-700-5000(免长途话费)。(021)61065000
网址:www.fund001.com
投资者可通过本基金管理人直销柜台办理开户、本基金A类基金份额及E类基金份额的申购、赎回、转换等业务。

2. 除基金管理人之外的其他基金份额销售机构

(1)交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系人:曹杨
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(2)上海慧基基金管理有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇潘浦公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路6518号A1002室
法定代表人:王翔
电话:(021)66370077
传真:(021)56086891
联系人:俞申阳
客户服务电话:(021)66370077
网址:http://www.tofund.com.cn
投资者可以通过交通银行股份有限公司以及上海慧基基金管理有限公司办理开户,本基金E类基金份额的申购、赎回、转换业务;通过交通银行股份有限公司办理开户,本基金A类基金份额的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务。
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构

名称:交银施罗德基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大厦二楼(裙)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼
法定代表人:阮红
电话:(021)61065097
传真:(021)61065064
联系人:单剑
(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:上海市浦东新区银城中路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:吕红卫
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:丁煜
经办律师:黎明、丁煜
(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6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:朱宏宇
经办注册会计师:薛竟、朱宏宇

四、基金的投资

本基金名称:交银施罗德活期货币市场基金
五.基金的投资目标
本基金为契约型开放式货币市场基金。基金存续期间不定期。

六.基金的投资范围
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,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,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。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规及相关规定。

八.基金的投资策略

本基金在保持组合高流动性资产的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。具体包括:

1. 短期利率水平预期策略
深入分析国家货币政策、短期货币市场利率变动、资本市场资金面的情况和合理预期的变化,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整货币市场资产的配置策略。

2. 收益率曲线分析策略

根据收益率曲线的变化趋势,采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时市场预期利率水平之间的关系,反映市场对较短期经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

3. 组合剩余期限策略、期限配置策略
通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整,达到保持合理的现金流,锁定组合剩余期限,以满足可能的、突发的现金需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,根据收益率曲线的情况,投资一定剩余期限的品种,稳定收益,锁定风险,满足组合目标期限。

4. 类别资产配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

5. 流动性管理策略

在满足基金投资者申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他方式),在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

6. 无风险套利策略

无风险套利策略包括:
跨市场套利:根据各细分市场短期金融工具的流动性和收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时,可增加交易所市场的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价和二级市场流通成交价之间的无风险套利机会。

跨品种套利:根据各细分市场不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,动态调整不同期限结构品种的资产配置比例。

7. 流动性配置策略

根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体变现能力。

8. 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向,一旦监管机构允许货币市场基金参与此类金融工具的投资,基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入投资范围,本基金将在届时相关法律法规的框架内,根据对该类金融工具的研究,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:活期存款利率(税后)。
本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

如果今后法律法规发生变化,或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以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。

十. 基金的风险收益特征

本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

十一. 基金投资组合报告

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。
基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1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。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。本报告财务资料未经审计师审计。

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	28,123,187,402.38	71.89
	其中:债券	27,393,187,402.38	71.61
	资产支持证券	150,000,000.00	0.38
2	买入返售金融资产	2,675,996,100.00	6.68
	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	8,306,787,056.64	21.31
4	其他资产	85,364,063.89	0.22
5	合计	39,119,224,194.10	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	3.72	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	400,036,079.96	1.03
2	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内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银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的单日平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的说明

本基金本报告期内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

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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分比例

序号	投资剩余期限	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	16.69	1.03
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天至—60天	20.13	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天至—90天	46.76	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天至—120天	0.26	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天至—397天	18.13	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
10	剩余存续期限超过397天的浮动利率债	27,373,187,402.38	72.28
	合计	100.87	1.03

4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,094,946,646.36	4.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	446,668,020.03	1.16
	其中:政策性金融债	446,668,020.03	1.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,675,809,498.97	7.42
6	中期票据	-	-
7	同业存单	22,969,703,215.22	68.23
8	其他	-	-
9	合计	27,373,187,402.38	72.28
10	剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-

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	债券余额(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111894102	18国债(附息)CD119	5,000,000	497,256,624.40	1.28
2	111819106	18国债(附息)CD106	5,000,000	497,003,008.18	1.28
3	111882723	18国债(附息)CD194	5,000,000	497,006,378.96	1.28
4	111870084	18国债(附息)CD216	5,000,000	489,241,249.12	1.26
5	111870170	18国债(附息)CD260	4,000,000	397,726,068.68	1.03
6	111821279	18国债(附息)CD179			