

融通通优债券型证券投资基金招募说明书摘要

(2019年第1号)

重要提示

融通通优债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经2016年6月17日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予融通通优债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1339号文)准予募集注册。本基金的基金合同于2016年8月9日正式生效。

投资有风险,投资人在认购(或申购)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,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。基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,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。

本招募说明书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对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关约定享有权利、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。

本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。截至2018年3月31日,本基金持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2019年2月9日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年12月31日(本招募说明书中的财务资料未经审计)。

一、基金合同生效日期
2016年8月9日
二、基金管理人
名称:融通基金管理有限公司
住所:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
设立日期:2001年9月22日
法定代表人:高峰
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
电话:(0755)26947517
联系人:魏兆亮

注册资本:12500万元人民币
股权结构:新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)40%。

(二)主要人员情况
1.现任董事情况
董事长高峰先生,金融学博士,现任融通基金管理有限公司董事长、历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事,平安证券投行部副总经理,北京远略投资咨询有限公司总经理,深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今,任公司董事长。

总裁王裕凤先生,工商管理硕士,现任日兴资产管理有限公司副总裁,全球资产管理兼首席投资官(国际),兼任ARK Investment Management GP LLC董事局成员代表,历任M&T Bank 分析师,PGIC (GE Capital 通用资本的子公司)交易员,General Reinsurance 基金经理,CGA Investment Management 高级基金经理,Structured Credit Partners LLC联合创始人兼首席投资官,Wachovia Corporation董事总经理兼全球信贷资产产品主、董事总经理兼全球市场和投资银行业务亚洲主理,宏利资产管理(Manulife Asset Management)香港亚洲固定收益资产产品主,日兴资产管理有限公司首席投资官(国际),日兴资产管理有限公司全球投资管理兼首席投资官(国际)。2018年3月至今,任公司董事长。

董事Allen Yan (颜耀福)先生,工商管理硕士,现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司(美国波士顿)分析师,富达投资公司(日本东京)经理,日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今,任公司董事。

董事张帆先生,工商管理硕士,清华大学EMBA。历任新时代证券经纪业务管理部董事总经理、总经理助理、副总经理、分公司总经理。2017年6月起至今,任公司董事。

2.现任监事情况
监事魏兆亮先生,金融学硕士,计算机科学硕士,现任公司监察稽核部总经理,历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月起至今,任公司监事。

3.公司高级管理人员情况
董事长高峰先生,金融学博士,现任融通基金管理有限公司董事长、历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事,平安证券投行部副总经理,北京远略投资咨询有限公司总经理,深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今,任公司董事长。

总经理张帆先生,工商管理硕士,清华大学EMBA。历任新时代证券经纪业务管理部董事总经理、总经理助理、副总经理、分公司总经理。2017年6月起至今,任公司董事。

常务副经理Allen Yan (颜耀福)先生,工商管理硕士。历任富达投资公司(美国波士顿)分析师,富达投资公司(日本东京)经理,日兴资产管理有限公司部长。2015年3月至今,任公司常务副总经理。

督察长涂卫东先生,法学硕士。历任国务院法院办公室(原国务院法院局)财务司公务员,曾在中国证监会法律部和基金监管部工作,曾是中国证监会公职律师。2011年3月至今,任公司督察长。

4.基金经理情况
(1) 现任基金经理情况
许富强先生,北京大学经济学硕士,7年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2011年7月加入融通基金管理有限公司,历任固定收益部研究员,投资经理,现任融通通优灵活配置混合、融通增祥债券、融通通优债券、融通可转债债券(中国可转债通优基金)基金经理。

王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,11年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易员兼投资与理财投资管理经理。2012年10月加入融通基金管理有限公司,历任融通通优、融通四季添利定期开放债券型证券投资基金、融通通优债券、融通通优债券、融通通优保本混合、融通汇财货币、融通易支付货币、融通通优债券、融通通优债券基金基金的基金经理。

(2) 历任基金经理情况
自2016年8月9日起至2018年5月17日,由张一格先生担任本基金的基金经理。自2018年5月18日起至2018年12月26日,由许富强先生担任本基金的基金经理。自2018年12月26日起至今,由许富强先生和王超先生担任本基金的基金经理。

5.投资决策委员会成员
公司固定收益公募基金投资决策委员会成员:固定收益投资总监、基金经理张一格先生、固定收益部副总监、基金经理王超先生、交易部总经理周奕夫先生、风险管理部总经理马洪先生。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人
1.基本情况
名称:宁波银行股份有限公司
住所:浙江省宁波市宁东路345号
办公地址:浙江省宁波市宁东路345号
法定代表人:陆华裕
注册日期:1997年04月10日
批准设立机关和批准设立文号:中国银监会,银监复[2007]64号
组织形式:股份有限公司
注册资本:伍拾陆亿玖仟柒佰柒拾玖万贰仟叁佰零伍人民币元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可【2012】1432号
托管部门联系人:王海燕
电话:0574-89103171

2.主要人员情况
截至2018年12月底,宁波银行资产托管部共有员工95人,100%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3.基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,宁波银行自2012年获得证券投资基金托管的资格以来,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,先进的技术装备和专业的服务团队,严格履行基金托管人职责,为境内广大投资者、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丰富和成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、ODI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、基金公司特定客户资产管理等门类齐全的托管产品体系,同时在国内外率先开展绩效评估、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12月底,宁波银行共托管66只证券投资基金,证券投资基金托管规模920.14亿元。

四、相关服务机构
(一) 基金份额发售机构
1.直销机构
(1) 融通基金管理有限公司
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码:518063
联系人:陈思贤
电话:(0755) 26949034
客户服务电话:400-883-8088(免长途话费)、(0755) 26949088

(2) 融通基金管理有限公司北京分公司
办公地址:北京市西城区太平桥大街84号丰汇时代大厦东翼5层502-507房间
邮政编码:100032
联系人:魏兆亮
电话:(010) 66190989

(3) 融通基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路601号上海中心大厦34层3405号
邮政编码:200120
联系人:刘佳佳
联系电话:(021) 38424889

(4) 融通基金管理有限公司网上直销
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层
邮政编码:518063
联系人:韦荣涛
电话:(0755) 26947504

2.其他销售机构
(1) 中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
联系人:李伟
电话:(010) 68098778

(2) 渤海银行股份有限公司
办公地址:天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘斌
电话:(022) 58136666
联系人:王宏
客户服务电话:400-888-8811

(3) 南京银行股份有限公司
办公地址:江苏省南京市玄武区中山路288号
法人代表:胡洪荣
电话:(025) 58666666
网址:www.njcb.com.cn

(4) 和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
法定代表人:王莉
地址:北京市朝阳区建外大街22号返利大厦10层
客服热线:400-920-0022、021-20365688
公司网站:liuake.hexun.com

(5) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人:陈洪生
联系人:梁云波
电话:0592-3122757
传真:0592-3122701
客户服务电话:400-918-0808

公司网站:www.xcds.com.cn
(6) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区吴淞路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人:汪静波
电话:021-38609735
传真:021-38609777
联系人:李娟
客服热线:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com

(7) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人:曹彩平
联系人:袁彩平
电话:0755-33227960
传真:0755-33227961
网址:www.zlfund.cn

(8) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼B层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3D座
法定代表人:其实
电话:021-54509988
传真:021-6438308
联系人:高莉莉
客服热线:4001818188
公司网站:1234567.com.cn

(9) 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:上海市浦东新区南1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:021-20213600
传真:021-68696916
联系人:张浩
客服热线:400-700-9695
公司网站:www.ehowbuy.com

(10) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
联系人:张斌
客服热线:4000-768-123
公司网站:www.fund123.com

(11) 上海互量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
法定代表人:张凯
联系人:邵晋芳
电话:021-2069-1806
客服热线:400-089-1289
网址:www.erichfund.com

(12) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文一西路91903室
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路18号
法定代表人:凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-86900423
联系人:吴强
客服热线:4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com

(13) 北京爱建基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪街道安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
电话:010-59601366-7024
传真:010-59602035
联系人:李海婧
客服热线:4008189800
公司网站:http://www.myfund.com/

(14) 上海得得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
电话:021-50683533
传真:021-50683633
联系人:曹洁
客服热线:400-821-7775
公司网站:http://aleadfund.com.cn/

(15) 北京汇成基金销售有限公司
地址:北京市海淀区中关村软件园A座1108室
法定代表人:王伟刚
联系人:王坤
客户服务热线:400-619-9059
网址:www.hcfund.com

(16) 一路财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号1号楼A2008室
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪飞
联系人:刘栋栋
电话:010-58312877
传真:010-58312898
客户服务热线:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com

(17) 北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
电话:010-57478183
传真:010-57609671
联系人:王晨
客服热线:4000893885
公司网站:www.qianjin.com

(18) 上海付基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19楼
办公地址:上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼
法定代表人:金浩
电话:021-33328989
传真:021-3332837
联系人:陈云齐
客服热线:400-821-3999
公司网站:ty.chinapam.com

(19) 深圳济安基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:李永刚
电话:0755-8399907-815
传真:0755-83999926
联系人:马力佳
客服热线:0755-83999907
公司网站:www.jinqianwo.cn

(20) 上海陆金所基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁博宇
电 话:021-20666952
客户服务热线:4008219031
(21) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10楼1006号
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦16层
法定代表人:杨晓
电话:010-63939101
传真:010-63935282
联系人:文雯
客服热线:400-166-1188
公司网站:http://8.jrj.com.cn

(22) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金田大厦23A
法定代表人:高峰
电话:0755-83665588
传真:0755-83665518
联系人:廖泽兰
客服热线:4008048688
公司网站:www.keynesasset.com

(23) 天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505室
法定代表人:林义相
电话:010-66045777
传真:010-66045618
联系人:董磊
客服热线:010-66045678
公司网站:www.txsec.com

(24) 奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
电话:0755-8946 0500
传真:0755-2167 4453
联系人:叶健
客服热线:400-684-0500
公司网站:www.ifastps.com.cn

(25) 方正证券股份有限公司
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华新国际大厦22-24层
法定代表人:施华
联系人:丁徽
电话:(0731) 85832463
客服热线:95571

(26) 中国银河证券股份有限公司
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
法定代表人:姜圣军
联系人:丁徽
电话:(0731) 85832463
客服热线:400-889-5618
(二) 登记机构
名称:融通基金管理有限公司
住所:深圳市罗湖区中一路88号时代金融中心19楼
办公地址:深圳市罗湖区中一路88号时代金融中心19楼
负责人:俞萍
经办律师:安冬、陆奇
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬
(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:上海市湖滨路202号普华永道中心11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
联系电话:(021) 23233888
传真:(021) 23233800
联系人:俞欣敏
经办注册会计师:陈玲、陈伟敏
五、基金的名称
融通通优债券型证券投资基金
六、基金的类型
契约型开放式
七、基金的投资目标
本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

八、基金的投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等法律法规或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的相关规定)。

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新发债,可转换为优先股资产及可转债转股的部分。

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。

本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于非现金资产净值的5%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略以及资产支持证券投资策略等部分。

1. 资产配置策略
本基金将根据宏观经济状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场环境,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场利率变化、债券的流动性以及信用水平,优化固定收益类金融工具资产比例配置,在有效控制风险的基础上,适时调整组合久期,以获得基金资产的稳定增值,提高基金总体收益。

2. 利率策略
本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析,进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低利率变动对组合带来的影响。本基金管理人的固定收益团队将定期对利率期限结构进行预判,并制定相应的久期目标,当预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期,以充分利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益水平。

3. 信用策略
本基金将根据不同信用等级债券与同期国债之间收益率利差的历史数据比较,并结合不同信用等级债券在不同市场时期利差变化及收益率曲线变化,调整债券类属品种的投资比例,获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

本基金还将积极、有效地利用本基金管理人比较完善的信用评级体系,研究和跟踪发行主体所属行业发展前景、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素,综合评估发行主体信用风险,确定信用产品的信用风险溢价,有效管理组合的整体信用风险。

4. 类属配置与个券选择策略
本基金根据债券品种特点,将市场划分为企业债、银行间国债、银行间金融债、央行票据、交易所国债等子市场,综合考虑市场的流动性和容量、市场的信用状况、各市场的风险收益水平、税收选择等因素,对各个市场之间的相对风险、收益(等价税后收益)进行综合分析后确定各类别债券资产的配置。

本基金从债券票息率、收益率曲线高度、绝对和相对价值分析、信用分析、公司研究等角度精选投资价值较高的投资品种。本基金力求通过对和相对定价模型对市场所有债券品种和投资价值评估,从中选择具有较高票息率且暂时被市场低估或估值合理化的投资品种。

5. 资产支持证券投资策略
本基金将对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、提前偿付利率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

6. 中小企业私募债券投资策略
中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性,普遍具有较高收益。本基金将深入发行人资质及公司运营情况,合理合规地参与中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用等级或发行主体信用等级变化情况,尽力规避风险,并获取超额收益。

七、基金的风险收益特征
本基金的风险收益特征为:中债综合指数收益率

中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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,调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案,而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日内指定媒介上予以公告。

十一、基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。

十二、基金投资组合报告
基金管理人于宁波银行股份有限公司根据基金合同约定,于2019年2月27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,并承担相应责任。

本报告投资组合数据截至2018年12月31日。本报告中列示的数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	央行票据	-	-
3	固定收益投资	2,005,276,169.43	98.07
其中:债券	2,005,276,169.43	98.07	
资产支持证券	-	-	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
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	1,167,332.57	0.06
8	其他资产	36,364,965.56	1.88
9	合计	2,044,880,367.56	100.00

2. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,919,034,169.43	98.00
其中:政策性金融债	1,919,034,169.43	98.00	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	86,242,000.00	4.40
9	其他	-	-
10	合计	2,005,276,169.43	102.41

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180212	18国开12	3,500,000	353,860,000.00	18.07
2	170209	17国开09	2,700,000	270,964,000.00	13.83
3	180201	18农发01	2,400,000	243,720,000.00	12.45
4	180406	18农发06	2,000,000	213,860,000.00	10.92
5	180211	18国开11	1,900,000	192,527,000.00	9.83

4. 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。

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

6. 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。

7. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1) 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 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。

(3) 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

8. 投资组合报告附注
(1) 本基金报告期内未发生内幕交易、操纵市场等违法违规行为。
(2) 本基金报告期内未发生受到公开谴责、处罚。

(二) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,824.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,362,041.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,364,965.55

(3) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

十三、基金的业绩
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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效日为2016年8月9日,基金业绩截止日为2018年12月31日。基金合同生效以来本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较如下:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年8月9日	-	-	-	-	-	-
1.基金合同生效日至2016年12月31日	0.28%	0.03%	-2.22%	0.12%	2.50%	-0.09%
2017年度	2.59%	0.10%	-3.38%	0.06%	5.97%	0.04%
2						