

# 海富通聚利纯债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:海富通基金管理有限公司**  
**基金托管人:交通银行股份有限公司**

## 重要提示

本基金经2016年7月26日中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1688号文准予注册募集。本基金的基金合同于2016年9月22日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本摘要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,应详细查阅基金合同。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人在申购本基金时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。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后,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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年3月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日。

## 一、基金管理人

### (一)基金管理人概况

名称:海富通基金管理有限公司  
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层  
法定代表人:杨仓兵  
成立时间:2003年4月18日  
电话:021-38650999  
联系人:吴晨霞  
注册资本:3亿元人民币  
股权结构:海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理B控股公司49%。

### (二)主要人员情况

杨仓兵先生,董事长。历任安徽省农业科学院计财科副科长,安徽康乐药业有限公司财务部经理,海通证券有限公司计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理,上海海振实业发展有限公司总经理,海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至2019年3月任海通证券股份有限公司资产管理总部总经理。2016年10月起兼任海通证券资产管理有限公司董事。2018年5月至2019年3月兼任海富通基金管理有限公司监事长。2019年3月至2019年4月任海富通基金管理有限公司董事。2019年4月起任海富通基金管理有限公司董事长。

任志强先生,董事,总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理,华宝兴业资产管理(香港)有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司,现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。2019年1月起兼任海富通资产管理(香港)有限公司董事长。

吴淑琛先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

丙政先生,董事,理学学士。历任上海警备区教导大队训练处教员,上海社会科学院人口与发展研究所助理研究员,海通证券股份有限公司监察室主任、二科副科长,海通证券股份有限公司人力资源开发部劳资科科长、干部科科长、总经理助理兼干部科科长,海通证券股份有限公司人力资源部总经理助理。2008年10月起担任海通开元投资有限公司监事。2014年11月起至今任海通证券股份有限公司人力资源部副总经理,2015年11月起兼任海通证券股份有限公司纪委委员,2016年11月起兼任海通创新资本管理有限公司董事。2017年12月起兼任海通证券股份有限公司监事。

Ligia Torres (陶尔女士)董事,法国与墨西哥双重国籍,双硕士学位,曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行,1996年加入法国巴黎银行集团工作,2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官,2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事,2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

Alexandre Wernot(韦山山)先生,董事,法国籍,金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国区开发负责人职务;2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务;2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

张馨先生,独立董事,博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、厦门大学财金系主任、厦门大学经济学院教授。2011年1月至今退休。

杨文斌(Philip YOUNG Wen Binn)先生,独立董事,管理学硕士(MBA)。历任美国大陆银行(芝加哥,台北)放贷经理,中华开发金控(台湾)资本市场经理,国际投资管理(台湾)执行副总经理,美银信託(香港)副总经理,日本野村资产管理(香港)投资总监,安泰人寿大中华地区投资总监,日本万通人寿投资总监及常务董事,中国平安保险集团资产管理公司投资总监。2006年7月至2009年4月任中国太平洋人寿保险股份有限公司与中国太平洋(集团)股份有限公司投资总监。2009年4月至2012年11月任太平洋资产管理有限责任公司投资总监。

刘正东先生,独立董事,法律硕士。历任上海市人民检察院铁路运输分院助理检察员,上海市虹桥律师事务所律师。1998年11月至2018年6月任上海市君悦律师事务所主任、高级合伙人。2018年6月起至今任上海市君悦律师事务所首席合伙人、合伙人会议主席。

陈静女士,独立董事,硕士。历任中国海洋石油总公司财务部干部,中外运-敦豪有限公司财务部经理,华盛顿普华会计师事务所(现普华永道)审计师,世界银行集团华盛顿总部高级会计官员、高级金融官员,中国证监会规划委高级顾问委员会兼会计部副主任,中国投资有限责任公司财务部副总监、董事总经理。2014年5月起至今任瑞士合众集团中国董事会成员。

曹志刚先生,监事长,经济学硕士。历任海通证券股份有限公司风险控制总部(稽核部)二级部经理、稽核部总经理助理,自2018年3月至今任稽核部副总经理。2016年11月起至今任海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司和海通创新资产管理有限公

司监事。

Bruno Weil(魏海诺)先生,监事,法国籍,博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理,法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行中国区负责人、零售部中国代表、南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团(中国)副董事长。

俞涛先生,监事,博士,CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理(英国)有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司,历任产品与创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

胡正万先生,监事,硕士。先后就职于成都机车车辆厂、四川省证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任基金会计、高级注册登记专员、注册登记负责人、基金运营副总监。2015年7月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

奚万荣先生,督察长,经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管,海通证券股份有限公司内部审计,2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起,任海富通基金管理有限公司督察长。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

陶闻雄先生,副总经理,硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中上实业发展有限公司主管会计、海通证券股份有限公司财务部副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,2003年4月至2006年4月任公司业务部负责人,2006年4月起任财务总监。2013年4月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

何树方先生,副总经理,博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长,魁北克蒙特利尔大学研究助理(兼职),魁北克公共退休金投资管理公司分析师、基金经理助理,富国基金管理有限公司总经理助理,2011年6月加入海富通基金管理有限公司,任总经理助理。2014年11月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

谈云女士,硕士。2005年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司,曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理,2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月起兼任海富通新内需混合

基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。2016年4月至2017年6月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券(原海富通双福分级债券)、海富通双利债券基金经理。2016年4月起兼任海富通安颐收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理。2016年9月起兼任海富通收益混合、海富通聚利债券及海富通欣荣混合基金经理。2017年2月起兼任海富通强化回报混合基金经理。2017年3月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017年3月至2018年1月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年7月起兼任海富通季季通利理财债券基金经理。

陆从凡先生,硕士。曾任瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益定量分析师,2015年4月加入海富通基金管理有限公司。2016年9月起任海富通聚利债券基金基金经理助理。

刘田女士,管理学学士。曾任上海银行同业客户经理,2016年4月加入海富通基金管理有限公司。2016年9月起任海富通聚利债券基金基金经理助理。投资决策委员会常设委员有:任志强,总经理;胡光涛,总经理助理;王智慧,总经理助理;孙海忠,总经理助理兼固定收益投资总监;杜晓海,量化投资部总监;王金祥,研究部总监;陈轶平,固定收益投资副总监;赵赫,年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的,则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD  
法定代表人:彭纯  
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号  
办公地址:中国(上海)长宁区仙霞路18号  
邮政编码:200336  
注册时间:1987年3月30日  
注册资本:7,422.63亿元人民币  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号  
联系人:陆志俊  
电话:95559

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

1.直销机构  
名称:海富通基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

### 法定代表人:杨仓兵

全国统一客户服务热线:40088-40099(免长途话费)

联系人:葛珊珊

电话:021-38650797

传真:021-33930160

### 2.其他销售机构

1)交通银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号  
法定代表人:彭纯  
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号  
客户服务电话:95559  
联系人:王菁  
网址:www.bankcomm.com  
2)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号楼二层  
地址:上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路88号金座26楼  
法定代表人:其实  
客户服务电话:400-1818-188  
联系人:王超  
网址: www.1234567.com.cn

### 二、登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司  
住所:北京市西城区太平桥大街17号  
注册地址:北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人:周明  
电话:010-50938782  
传真:010-50938907  
联系人:赵办清

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:上海市湖滨路202号台湾水道中心11楼  
负责人:俞卫锋  
电话:021-31358666  
传真:021-31358600  
联系人:陈颖华  
经办律师:孙睿、陈颖华  
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号台湾水道中心11楼  
法定代表人:李丹  
经办注册会计师:薛竟、都晓晔  
电话:(021) 23238888  
传真:(021) 23238800  
联系人:都晓晔

## 四、基金的名称

本基金名称:海富通聚利纯债债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

基金类型:契约型、开放式

## 六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上,追求基金资产长期稳定增值,力争实现高于业绩比较基准的投资收益。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要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、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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

### 一、投资策略

#### 1.资产配置策略

本基金为债券型基金,对债券的投资比例不低于基金资产的80%。在此约束下,本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。

#### 2.债券类属资产配置

类属配置包括国债、金融债、企业债等固定收益品种之间的配置。本基金根

据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重。类属配置主要根据各部分的利差的扩大及收窄分析,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属,借以取得较高的总回报。

#### 3.债券投资组合策略

债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

#### (1)利率策略

利率策略主要是根据对宏观经济环境判断,预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势,从而确定组合的整体久期,有效控制基金资产风险。当预测利率上升时,适当缩短投资组合的目标久期,预测利率水平降低时,适当延

#### 长投资组合的目标久期。

#### (2)信用策略

信用策略主要是根据不同信用等级资产的相对价格,确定资产在不同债券类属之间的配置,并通过对债券的信用分析,确定信用债的投资策略。本基金将分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略。

#### 1)基于信用利差曲线变化策略

信用利差曲线的变化受宏观经济周期及市场供求两方面的影响较大,因此本基金一方面通过分析经济周期及相关市场的数据,判断信用利差曲线的变化,另一方面将分析债券市场的市场容量、市场形势预期、流动性等因素对信用利差曲线的影响,综合各种因素确定信用债总的投资比例及分行业投资比例。

#### 2)基于信用债信用变化策略

本基金主要依靠内部信用评级系统分析信用债的信用水平变化、违约风险及理论信用利差等。本基金信用评级体系将通过定性定量相结合,着力分析信用券的实际信用风险,并寻求足够的收益补偿。另外,评级体现将从动态的角度,分析发行人的资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而

预测信用水平的变化趋势,决定投资策略的变化。

#### (3)收益率曲线策略

根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理配置不同期限品种的配置比例。通过合理期限安排,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,在保持组合一定流动性的同时,可以从长期、中期、短期债券的价格变化中获利。

#### (4)杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础,利用回购等方式融入低成本资金,并购买具有较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较,判断是否存在利差套利空间,从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时,基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

#### 4.中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险,并寻求足够的收益补偿,增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析,从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而预测信用水平的变化趋势,决定投资策略。在流动性风险控制,本基金将重点放在一级市场,并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,严格防范流动性风险。

#### 5.资产支持证券投资策略

对于包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。

## 二、投资决策和程序

### 1.决策依据

(1)投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;  
(2)投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;  
(3)投资相应策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自

独立完成相应的研究报告,为投资决策提供依据。

### 2.决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期或不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下:

(1)投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规,决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策;决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整;对旗下基金重大投资的批准与授权等。  
(2)投资部门负责人在公司有关规章制度授权范围内,对重大投资进行审查批准;并且根据基金合同的有关规定,在组合业绩比较基准的基础上,制定各组资产和行业配置的偏差度指标。  
(3)分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析,提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。  
(4)定期不定期召开部门例会,基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上,确立公司针对市场、资产和行业的投资观点,该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。  
(5)基金经理在投资部门负责人授权下,根据部门例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标,在充分听取分析师债券配置意见的基础上,进行投资组合的资产及行业配置;之后,在债券分析师设定的债券池内,根据所管理组合的风险收益特征和流动性指令,构建基金组合。  
(6)基金经理下达交易指令至交易室进行交易。  
(7)风险管理部负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。  
(8)风险管理部负责完成内部基金业绩评估,并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序做出调整。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率  
采用该业绩比较基准主要基于以下考虑:  
中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数的有限公司编制并发布的首只债券类指数。样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

## 十、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4月19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止至2018年12月31日(“报告期末”)。

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	固定收益投资	2,439,269,840.00	88.79
	其中:国债	2,292,500,840.00	83.46
	资产支持证券	146,360,000.00	5.33
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	263,183,034.78	9.58
	其中:买入式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	12,723,000.00	0.46
7	其他资产	32,139,926.57	1.17
8	合计	2,747,328,803.33	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
2.1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。  
2.2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。  
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。

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

3	金融债券	345,439,000.00	12.68
	其中:政策性金融债	345,439,000.00	12.68
4	企业债券	792,236,840.00	27.40
5	企业短期融资券	150,360,000.00	5.48
6	中期票据	1,044,889,000.00	38.06
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,292,909,840.00	83.61

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

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	101751041	17汇金MTN001	2,000,000	204,720,000.00	7.46
2	1722028	17鄂烟债	2,000,000	203,780,000.00	7.42

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101751841	17汇金MTN001	2,000,000	204,720,000.00	7.46
2	172328	17国债附息	2,000,000	203,780,000.00	7.42
3	130544	16国债03	1,100,000	109,516,000.00	3.99
4	101464004	14国债MTN001	1,000,000	101,220,000.00	3.69
5	101451047	14铁道MTN002	1,000,000	101,180,000.00	3.68

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十名资产支持

证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1809006	18国证A1_B2	2,000,000	146,360,000.00	5.33

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。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资政策  
根据本基金合同,本基金暂不投资国债期货。

10.2 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。

10.3 本期国债期货投资评价  
根据本基金合同,本基金暂不投资国债期货。

11 投资组合报告附注  
11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

11.3 其他资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,810.73
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	32,138,115.04
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	质押借款	—
8	其他	—
9	合计	32,139,925.77