

富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2019年第1号

基金管理人:富荣基金管理有限公司
基金托管人:杭州银行股份有限公司

【重要提示】

1. 本基金根据2018年9月10日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予富荣富开1-3年国开债纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2018〕1482号)进行募集。本基金于2018年10月31日正式生效。

2. 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、收益和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

3. 投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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导致的投资风险,由投资者自行承担。

4. 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,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券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等。基金管理人在基金投资管理过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

5. 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低风险品种。

6. 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、政策性金融债、债券回购、银行存款、同业存单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)。

7. 本基金初始募集面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

8. 本基金的投资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。

9. 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。

10. 本招募说明书所载内容截止日为2019年4月30日,有关财务数据截止日为2018年4月31日,净值表现截止日为2018年3月31日,本报告中列财务数据未经审计。

11. 本基金托管人杭州银行股份有限公司已于2019年5月24日复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:富荣基金管理有限公司
注册地址:广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20室
办公地址:深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场3501室
法定代表人:杨小舟
设立日期:2016年1月25日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监许可【2015】3118号
组织形式:有限责任公司
注册资本:2亿元人民币
存续期限:永续经营
联系人:毛志华
联系电话:0755-84356636
传真:0755-83230787
股权结构:

股东名称	出资比例
广州科技金融创新投资控股有限公司	50%
深圳嘉年实业股份有限公司	45.1%
湖南典创投资开发有限公司	4.9%

(二)主要成员情况

1. 董事会成员

杨小舟先生,董事长,大连理工大学硕士研究生。历任交通银行沈阳分行国际部国际结算员、信贷科科长、中信银行沈阳皇姑支行副行长、广发银行南湖支行行长、广发银行沈阳直属支行行长助理、副行长、行长兼党委书记、广发银行沈阳分行行长兼党委书记、广发银行深圳分行行长兼党委书记。

郭容辰女士,董事,上海交通大学法学硕士,历任交通银行深圳福田支行行长、深圳分行零售信贷部总经理、个人金融部总经理、华夏银行深圳分行个人金融部总经理、金鹰基金管理有限公司副总经理,现任富荣基金管理有限公司总经理。

罗劲生先生,董事,湖南大学工商管理硕士,曾任广州农村商业银行股份有限公司华夏支行集团客户事业部副总经理。现任广州汇浪澳丰股权投资基金管理有限公司常务副总经理、四川汇源光通信股份有限公司董事长、富荣基金管理有限公司董事。

郭涛先生,董事,上海高级金融学院研究生(在读)。现任深圳市益德置业有限公司总经理、深圳福元德租赁有限公司董事长兼总经理、深圳融博融资租赁有限公司董事长兼总经理、深圳市天汇鑫达担保有限公司总经理、深圳市亿尔德投资有限公司法人、嘉年实业股份有限公司董事、富荣基金管理有限公司董事。

李峰先生,独立董事,芝加哥大学会计学博士。现任职美国密歇根大学Ross商学院终身教授、上海交通大学上海高级金融学院访问教授、上海宏力达信息技术股份有限公司独立董事、银科投资控股有限公司独立董事、富荣基金管理有限公司独立董事。

林斌先生,独立董事,厦门大学经济学博士。现任中山大学管理学院会计学系教授、富荣基金管理有限公司独立董事。

余关键先生,独立董事,西南财经大学工业经济硕士研究生。曾任中国银行深圳分行信贷处处长、中国银行深圳分行风险管理处处长、深圳赛格、深圳特发集团董事、邦信资产管理公司董事总经理,对外经济贸易股份有限公司董事长、东方资产管理公司办事处总经理,现任东银集团(深圳)股份有限公司董事、深圳宝田股份有限公司独立董事、富荣基金管理有限公司独立董事。

2. 监事会成员

基金管理人设监事会,设监事两名,其中一名为职工监事。

卢伟女士,监事,大专。在盈投投资有限公司任职,现任富荣基金管理有限公司监事。

毛志华先生,职工监事,本科。现任富荣基金管理有限公司监事。

3. 高级管理人员

杨小舟先生,董事长,大连理工大学硕士研究生。历任交通银行沈阳分行国际部国际结算员、信贷科科长、中信银行沈阳皇姑支行副行长、广发银行南湖支行行长、广发银行沈阳直属支行行长助理、副行长、行长兼党委书记、广发银行沈阳分行行长兼党委书记、广发银行深圳分行行长兼党委书记。

郭容辰女士,总经理,北京大学法学硕士,历任交通银行深圳福田支行行长、深圳分行零售信贷部总经理、个人金融部总经理、华夏银行深圳分行个人金融部总经理、金鹰基金管理有限公司副总经理,现任富荣基金管理有限公司总经理。

苏春华先生,副总经理、首席投资官,中山大学硕士研究生,曾任广州期货贸易有限公司期货研究员、君安证券广州营业部高级分析师、光大银行广州证券副经理兼研究室主任、广州银行资金营运中心总经理兼首席交易员,历任广东华兴银行金融市场部总经理、金融市场营销条线业务总监、总行副行长,现任富荣基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

林峰先生,副总经理,法学专业本科。曾任中国银行广州分行、广州白云支行会计,民生银行广州分行会计结算科负责人、系统财务科科长、越秀支行行长,广东省农村信用社联合社历任资金调剂营运中心总经理助理、副总经理、负责人等,现任富荣基金管理有限公司副总经理。

滕大江先生,督察长,中南大学工学学士,先后供职于平安证券、平安大华基金管理有限公司、前海开源基金管理有限公司监察稽核部门。现任富荣基金管理有限公司督察长。

4. 本基金基金经理

吕晓蓉女士,清华大学工商管理硕士,曾任普华永道中天会计师事务所审计师、嘉实基金管理有限公司组合头寸管理、新股、信用债、转债研究员,现任富荣基金管理有限公司基金经理。

5. 投资决策委员会成员的姓名、职务

郭容辰女士,投资决策委员会召集人、公司董事、总经理。

苏春华先生,投资决策委员会副主任委员、副总经理、首席投资官。

林峰先生,投资决策委员会委员、副总经理。

吕晓蓉女士,投资决策委员会委员、基金经理。

邓宇翔先生,投资决策委员会委员、权益投资部总监、研究部总监、基金经理。

万方毅女士,投资决策委员会委员、固定收益部副总监。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

名称:杭州银行股份有限公司
注册地址:杭州市下城区庆春路46号
办公地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人:陈震山
成立时间:1996年9月25日
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币36.64亿元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可【2014】337号
电话:0755-83885180
联系人:何丽敏

(二)主要人员情况

杭州银行股份有限公司资产托管部有从业人员43名。其中设总经理1人,负责全面组织和协调资产托管部的相关工作。设总经理助理1人,分管托管运营工作。资产托管部根据岗位职责分成3个团队:市场营销团队、风控监督团队和运营团队。从事资金清算、估值核算、投资监督、信息披露、内部稽核监控业务的执业人员41人。

三、基金托管业务经营情况

杭州银行股份有限公司自2014年3月获得中国证券监督管理委员会和中国银行监督管理委员会的核准,取得证券投资基金托管资格(证监许可[2014]1337号)。目前,杭州银行股份有限公司已全面开展了包括证券投资基金、基金公司资管产品、证券公司资管产品、信托计划、商业银行理财产品、期货公司资管产品、私募投资基金等各类资产托管业务。

截至2019年4月,资产托管业务余额11062亿元,客户数量接近300家,托管资产种类丰富,包括:证券投资基金、信托计划、证券公司客户资产管理计划、基金公司特定客户管理计划、商业银行理财资金、股权投资基金等。杭州银行股份有限公司已托管了易方达裕如混合基金、天弘弘运宝货币A基金、天弘弘运宝货币B基金、博时裕利纯债基金、浙商惠丰债券型基金、浙商惠享债券型基金、海富通瑞丰债券型基金等25只公募基金。目前正在与多家基金管理公司洽谈公募基金托管合作。

二、基金托管人的内部控制制度

杭州银行股份有限公司建立了较为完善的法人治理结构,形成了从董事会、经营层到操作层,覆盖信用风险、市场风险、操作风险在内的全面风险管理体系,资产托管部也牢固树立风险意识,采取各种必要措施防范和化解风险。

1. 建立科学、严格的岗位分离制度

明确划分各岗位职责,系统运维、估值核算、资金清算、投资监督和内部稽核监控等重要岗位,人员严格分开,估值核算、资金清算、投资监督等能接触到基金交易数据的岗位人员进行物理分离。

2. 建立健全受托管理体系

制定了《杭州银行证券投资基金托管业务受托管理办》,将托管管理贯穿于资产托管业务的始终,各岗位业务人员均在规定授权范围内行使相应职责。

3. 建立完备的备份机制

资产托管的业务数据及其他重要数据每日进行安全备份,定期将数据完整、真实、准确地传输到不可更改的介质上,并要求集中异地保存,保存期限至少20年。资产托管部关键岗位人员也采用双人备份制度。

4. 建立完备有效的应急措施

制定了《杭州银行证券投资基金托管业务应急处理管理办法》,并针对托管业务备份、信息系统及资金清算等业务制定了专项应急预案,对于各类突发事件、紧急事件或故障,定期开展应急演练,检验应急预案的有效性和可靠性。

5. 建立严格的保密机制

制定了《杭州银行证券投资基金托管业务保密管理办法》,资产托管部配备独立IT系统,严格禁止无关人员进入资产托管部办公区域,能接触到基金交易数据的岗位人员进行物理分离,并采用电话录音、监控录像、信息加密传递技术等手段来实现风险控制。

6. 建立有效的内部稽核制度

资产托管部设立稽核监控岗,直接对资产托管部总经理负责,独立对各岗位、各项业务实施全面的监督反馈,以确保资产托管各项业务合法合规、安全有效,切实履行托管人职责。

三、基金托管人对基金管理人

基金管理人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的行为,对基金管理人进行业务监督、检查。

基金托管人发现基金管理人存在违反法律法规和基金合同的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时,通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人指令违反法律法规,违反基金合同有关规定,或违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1. 直销机构

名称:富荣基金管理有限公司直销中心
注册地址:广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20室
办公地址:深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场3501室
法定代表人:杨小舟
电话:0755-84356629
传真:0755-83230902
客服电话:4006855600
网站:www.furac.com.cn

2. 其他销售机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华鑫证券有限责任公司	注册(办公)地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(1)单元 客户服务电话:95323 网址:www.cfsc.com.cn 办公地址:上海市杨浦区昆明路618号A1002室 客户服务电话:4008205369 网址:www.jiuyutun.com.cn
2	上海慧基基金销售有限公司	注册(办公)地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦7楼 客户服务电话:4006-788-887 网址:众基基金网www.zjfund.cn 基金投资官网www.jimw.com
3	深圳众禄基金销售有限公司	注册(办公)地址:北京市朝阳区东三环东大街1号院6号楼2单元21层222507 客户服务电话:400 0618 518 网址:http://t.jianjiaapp.com
4	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册(办公)地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层1022室 客户服务电话:400-786-8868-5 网址:www.chtfund.com
5	北京恒天明泽基金销售有限公司	办公地址:广东深圳市福田区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室 客户服务电话:400-128-6000 网址:caohb.com
6	深圳盈信基金销售有限公司	注册(办公)地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙大厦8楼A-A-1(811-812) 客户服务电话:4007-903-688 网址:http://www.fundying.com/
7	上海财咨基金销售有限公司	注册(办公)地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号6楼01、02、03室 客户服务电话:400-711-8718 网址:www.wacaijin.com
8	诺亚正行基金销售有限公司	注册(办公)地址:上海市杨浦区区长阳路1687号2号楼 客户服务电话:4008-2115-399 网址:www.noah-fund.com
9	上海凯石财富基金销售有限公司	注册(办公)地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 客户服务电话:400-643-3889 网址:www.vstonewealth.com

(二)登记机构

名称:富荣基金管理有限公司

住所:广东省广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20

办公地址:深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场3501室

法定代表人:杨小舟

联系人:黄文飞

电话:0755-84356604

传真:0755-83230787

(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:上海市浦东新区东长安路1号东方广场安永大楼16层

办公地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

法定代表人:毛锐

电话:+86 10 58153000

传真:+86 10 85182928

签字注册会计师:吴翠蓉 高鹤

联系人:吴翠蓉

四、基金的名称

五、基金的类型

基金的类型:债券型证券投资基金。

六、基金的投资

(一)投资目标

在谨慎投资的前提下,追求基金资产的长期、稳定增值。

(二)投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、政策性金融债、债券回购、银行存款、同业存单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)。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等资产,不参与一级市场的新股

申购、增发新股、可转换债券以及可分离交易可转债,也不投资二级市场的可转换债券。

本基金不投资于地方政府债、非政策性银行金融债、资产支持证券、信用债(包括企业债、公司债、中期票据、短期融资券)。

80%; 本基金持有剩余期限为1-3年国开债的比例不低于非现金基金资产的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,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

(三)投资策略

本基金将主要投资于剩余期限为1-3年国开债,通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况进行综合分析,主要在剩余期限为3年期限及3年期限以内的国开债中进行配置和选择。

久期控制,考虑到全球经济体已处于紧缩周期,为降低利率风险,本基金主要投资于剩余期限为1-3年国开债,同时,根据对宏观经济发展状况、债券市场运行情况等因素的分析调整组合的整体久期,有效的控制整体久期风险,并借机获得收益。

期限结构配置上,在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,以提高组合收益。

相对价值判断上,根据对同类债券的相对价值判断,选择价格合适的交易时机,增持相对低估,价格将上升的个券,减持相对高估,价格将下降的个券。

(四)投资限制

1. 组合限制

本基金对债券的投资比例不得低于基金资产的80%,本基金投资于剩余期限为1-3年国开债的比例不低于非现金基金资产的80%;

(2) 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,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款;

(3) 本基金持有一家发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(6) 本基金总资产不得超过基金资产净值的140%;

(7) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(8) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(9) 法律法规、中国证监会及中国人民银行规定的其他比例限制。

除上述第(2)、(7)、(8)项外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

2. 本基金不得投资于以下金融工具:

(1) 股票;

(2) 可转换债券、可交换债券;

(3) 地方政府债、非政策性银行金融债、资产支持证券、信用债(包括企业债、公司债、中期票据、短期融资券);

(4) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

3. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1) 承销证券;

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资;

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其具有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人可在履行适当程序后,则本基金可不受上述规定的限制。

(五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债-国开行债券总全价(1-3年)指数收益率

1. 本基金主要投资于剩余期限为1-3年国开债,投资于剩余期限为1-3年国开债比例不低于非现金基金资产的80%;

2. 中债-国开行债券总全价(1-3年)指数是中债-国开行债券总指数待偿分期分段子指数,中债-国开行债券总指数隶属于中债总指数族,该指数成分券由国开开发银行在境内公开发行且上市流通的政策性银行债组成,是一个反映境内国开行债券价格走势情况的总指数。

综上,中债-国开行债券总全价(1-3年)指数可以较好地体现本基金的投资特征与目标客户群的风险收益偏好。因此,本基金选取中债-国开行债券总全价(1-3年)指数收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时,经基金管理人与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

(六)风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低风险品种。

(七)基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1. 有利于基金资产的安全与增值;

2. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;

3. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不正当利益;

(八)基金投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年5月24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,保证复核数字不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日,本报告中列财务数据未经审计。

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	341,363,000.00	76.92
	其中:债券	341,363,000.00	76.92
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	93,630,246.82	21.10
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	302,564.62	0.07
9	其他	8,496,474.74	1.91
10	合计	443,792,286.18	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股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(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

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	30,459,000.00	6.87
2	央行票据	-	-
3	金融债	310,904,000.00	70.09
4	其中:政策性金融债	310,904,000.00	70.09
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转换(可交换)债	-	-
9	同业存单	-	-
10	其他	-	-
10	合计	341,363,000.00	76.95

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	140210	14国开10	700,000	73,577,000.00	16.59
2	140203	14国开03	500,000	52,510,000.00	11.84
3	140221	14国开21	500,000	52,165,000.00	11.76
4	120201	12国开01	400,000	40,824,000.00	9.20
5	180202	18国开02	400,000	40,664,000.00	9.17

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

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</