

海富通季季通利理财债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2019年第2号）

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
重要提示
本基金经2014年9月17日中国证券监督管理委员会【2014】962号文准予注册募集。本基金的基金合同于2017年7月14日正式生效。基金类型为契约型开放式。本基金以“运作期滚动”方式运作，第一期运作期为2017年7月14日至2017年9月27日。第二期运作期中申购期为2017年9月28日至2017年10月11日。截至第二期集中申购期最后一日即2017年10月11日终，本基金的基金资产净值加上本基金集中申购期最后一日的申购申请金额后的余额低于5000万元且基金份额持有人人数不满200人，根据基金合同约定，本基金管理人决定暂停本基金下一运作期运作。

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本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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在集中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。基金管理人提醒投资人基金投资的“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。

本基金单一投资者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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年7月4日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

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BE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，安徽立康药业有限公司财务部经理，海通证券股份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总经理助理。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6月至2019年6月兼任海富通基金管理有限公司董事长。2019年3月至2019年4月任海富通基金管理有限公司董事长。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，华宝信托投资有限公司总裁助理兼董事兼秘书，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2月起兼任海富通资产管理（香港）有限公司董事长。

吴淑珉先生，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总主持、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。

刘政先生，董事，理学学士。历任上海警区教导大队训练处教官，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专委、二科副科长，海通证券股份有限公司人力资源开发部资料科长、二科副科长、总经理助理兼二科副科长，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（陶乐斯）女士，董事，法国与墨西哥双国籍，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 Wemo（韦山）先生，董事，法国籍，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月任法国兴业银行全球市场部担任执行董事，中国业务开发负责人职务；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助理、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高级总监。

张馨先生，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。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）高级投资，中华开发金融（台湾）资本市场经理，国际投资信托（台湾）执行副总经理，美银信托（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，日本野村人寿投资总监及业务董事，中国平安保险集团资产管理公司投资总监。2006年7月至2010年4月任海富通基金管理有限公司副总经理兼首席财务官（集团）副总经理兼投资总监。2009年4月至2012年11月任太平洋资产管理公司投资总监。

刘正先生，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月担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、高级金融官，中国证监会规划发展部高级顾问委员会副主任，中国投资有限公司财务部副总监、董事兼总经理。2014年5月起至今任瑞士大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）二级经理、稽核部总经理助理，自2018年3月至今任稽核部总经理。2016年11月起至今任海通吉来股权投资基金管理有限责任公司和海通创新资本管理有限公司董事。

Bruno Weil（魏涛哲）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东亚负责人员、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、亚洲金融机构投资业务负责人、零售部中国区代表、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。先后就职于上海摩根基金管理公司，摩根资产管理（英国）有限公司，曾任上海摩根资产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，历任产品副总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司副总经理助理。

胡正方先生，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等公司。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任基金会计、计划运营部专员、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。

莫万荣先生，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。

陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中实业发展有限公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。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月任公司财务部负责人，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。

何树才先生，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所（兼职），魁北克公共退休基金管理公司分析师、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。

谈云飞女士，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通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月调离海富通新内混合格基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。2016年4月兼任海富通双债债券（原海富通双债分级债券）、海富通双债债券基金经理。2016年4月兼任海富通安颐稳健混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016年9月起兼任海富通欣益混合、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。

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；王金律，研究部总监；陈铁平，固定收益部总监。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。

一、基金托管人基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：刘连铸
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露负责人：王永民
客服电话：95566
传真：(010) 66594942

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：邵嘉磊
电话：021-38650797
传真：021-33830160

2、其他销售机构

（1）中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：刘连铸
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
客户服务电话：95566
联系人：陈思思
网址：www.boc.cn

（2）中国工商银行股份有限公司
住所地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：陈四清
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
客户服务中心电话：95588
联系人：陈宏

（3）长江证券股份有限公司
住所地址：湖北省武汉市新华路8号
法定代表人：李新华
办公地址：武汉市新华路8号长江证券大厦
客户服务电话：95579或4008888999
联系人：奚博宇
网址：www.95579.com

（4）广州证券股份有限公司
住所地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：胡伏云
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
客户服务电话：95368
联系人：林洁茹
网址：www.gzs.com.cn

（5）国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
客户服务电话：95310
联系人：刘婧璐、贾鹏
网址：www.gjqz.com.cn

（6）华龙证券股份有限公司
注册地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人：李晓安
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
客户服务电话：95368
联系人：范坤
网址：www.hlzq.com.cn

（7）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：刘世安
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
客户服务电话：95511-8
联系人：周皓
网址：stock.pingan.com

（8）中泰证券股份有限公司
注册地址：济南市市中区经七路96号
法定代表人：李玮
办公地址：山东省济南市市中区经七路96号
客户服务电话：95538
联系人：许基华
网址：www.ztsc.com.cn

（9）申万宏源证券股份有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
客户服务电话：95523或4008895523
联系人：陈敏
网址：www.swhysc.com

（10）申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：韩志谦
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
客户服务电话：4008000562
联系人：王怀春
网址：www.hysec.com

（11）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
法定代表人：林义相
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座505
客户服务电话：010-66045678
联系人：谭磊
网址：jijin.txfund.com

（12）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：王常青
办公地址：北京市朝阳区朝内大街188号
客户服务电话：95587或4008888108
联系人：许梦圆
网址：www.csc108.com

（13）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
法定代表人：张佑君
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
客户服务电话：95548
联系人：王一峰
网址：www.cs.citic.com

（14）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：姜晓林
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
客户服务电话：95548
联系人：刘晓明
网址：www.zxwt.com.cn

（15）中信期货有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层
法定代表人：张皓
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层
客户服务电话：4009908826
联系人：刘雯
网址：www.citicsf.com

（16）华西证券股份有限公司
注册地址：成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人：杨炯华
办公地址：成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
客户服务电话：95584
联系人：谢国民
网址：www.hx168.com.cn

（17）大同证券有限责任公司
注册地址：山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
法定代表人：董祥
办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心12层
客户服务电话：4007121212
联系人：薛群
网址：www.dtsco.com.cn

（18）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人：陈共炎
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
客户服务电话：4008888888或95551
联系人：李国欣
网址：www.chinastock.com.cn

（19）世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人：李强
办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
客户服务电话：4008323000
联系人：王雯
网址：www.csco.com.cn

（20）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人：薛峰
客户服务电话：4006-788-887
联系人：唐凯莉
网址：www.zlfund.cn 及 www.jimw.com

（21）上海好实基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼241号
法定代表人：杨文斌
客户服务电话：400-700-9665
联系人：高源
网址：www.howbuy.com

（22）上海长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2202室
法定代表人：张跃伟
客服电话：400-820-2899
联系人：单丙辉
公司网站：www.erichfund.com

（23）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2层
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

（24）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京中环北路27号院5号楼32层3201单元3212、3211单元
地址：北京顺义区天竺镇沙岭安富街6号
法定代表人：闫振杰
客户服务电话：400-818-000
联系人：罗恒
网址：www.myfund.com

（25）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路1号903室
法定代表人：吴强
地址：浙江省杭州市文二西路1号903室
客户服务电话：0571-88920897、4008-773-772
联系人：董一峰
网址：www.5ifund.com

（26）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：郭坚
客服电话：4008 6666 18
联系人：程晨
网址：https://www.lu.com

（27）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人：江卉
客服电话：956118 / 400-098-8511
联系人：韩明磊
网址：京东金融APP

（28）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表：钱昊飞
客服电话：95177
联系人：喻明明
网址：www.snjifund.com

（29）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法人代表：钟斐斐
客服电话：400-159-9288
联系人：侯芳芳
网址：www.danjuanapp.com

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：010-59378782
传真：010-59378807
联系人：赵亦清

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：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：孙睿
经办律师：黎明、孙睿

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号展业银行大厦6楼
办公地址：上海市湖路路202号普华永道中心11楼
法定代表人：李丹
经办注册会计师：薛竞、都晓燕
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：都晓燕

四、基金的名称
本基金名称：海富通季季通利理财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
在力求基金资产安全性的基础上，通过合理的资产配置和个券选择，为投资者提供稳定的资产回报。

七、基金的投资方向
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的固定收益类工具，具体包括现金，协议存款、通知存款、银行定期存款、大额存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资于可转换债券，但可以通过投资分离交易可转债上市分离出来的债券。

如法律法规及监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略
（一）、投资组合策略
本基金将基于投资组合与运作期匹配作为基本原则，本基金将严格采用买入并持有策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余运作期的固定收益类工具。在集中申购期内，主要采用流动性管理策略。

1、资产配置
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，对各类资产的利率水平进行判断，从而决定资产配置比例。

2、银行存款投资策略
在对银行存款利率深入分析的基础上，将对银行的信用等级等因素进行研究，在严控风险的前提下决定各银行存款的投资比例。

3、短期信用债投资策略
信用债券收益率可以分解为与其具有相同期限的无风险基准利率加上反映信用风险的信用利差之和。信用利差收益主要受两方面的影响：一是该债券对应的信用利差曲线；二是该信用债券本身的信用变化影响，因此本基金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，挑选预期适当的信用债券进行投资。

4、债券回购投资策略
回购策略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，判断是否存在利率套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。另外，本基金将根据运作期内资金面情况，决定回购期限的选择。

（二）、投资决策程序
1、决策依据
（1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
（2）宏观经济、微观经济运行状况、货币政策和财政政策执行状况、货币市场和证券市场运行状况；
（3）分析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
1）投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的投资策略、审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
2）相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。
3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金集中申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。

4）交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。
5）监察稽核部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对投资组合进行风险评估与监控。

九、基金的风险收益特征
本基金为理财债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期风险与预期收益低于混合型基金和股票型基金。

十、基金的投资组合报告
基金管理人及基金董事及董事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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月2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2019年6月30日（“报告期末”）。

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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	-	-
4	其他资产	-	-
5	合计	-	-

2 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）
1	报告期末债券回购融资余额	-
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

3 投资组合平均存续期限说明
3.1 投资组合平均存续期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	-
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	-
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	-

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本基金本报告期末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布比例

序号	平均剩余期限	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	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天含—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天含—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天含—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天含—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	-	-

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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%—0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	-
报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明	-
本基金本报告期内正偏离度的绝对值未超过0.25%。	-
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明	-
本基金本报告期末正偏离度的绝对值未超过0.5%。	-
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。	-

9 投资组合报告附注

基金计价方法说明
2007年7月1日起实施新会计准则后，本基金所持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

9.2 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。

9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收利息清算款	-
3	应收证券	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	合计	-
8	其他	-