

兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要

(2020年第3号)

【本基金不向个人投资者公开发售】

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经2017年11月10日中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2029号文准予募集注册,基金合同于2017年12月29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投资价值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。

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。

投资有风险,投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体经济、个别证券价格、市场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,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的流动性管理风险,本基金的特定风险等等。本基金是债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的较低风险的品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或超过50%,本基金不向个人投资者销售。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。

本基金可投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发生主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

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。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。

本基金信息披露事项以法律法规规定及本招募说明书“第十七部分基金的信息披露”章节约定的内容为准。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。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的权利、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。

本基金本次更新招募说明书仅对基金经理相关信息进行更新,相关信息更新截止日为2020年7月15日。除非另有说明,本招募说明书(更新)相关内容截止日为2020年2月29日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年12月31日(本招募说明书中的财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人情况

名称:兴业基金管理有限公司
住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址:上海市浦东新区银城路167号13、14层
法定代表人:官恒秋
设立日期:2013年4月17日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2013]288号
组织形式:有限责任公司
注册资本:12亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:021-22211888
联系人:郭晓燕
股权结构:

股东名称	出资比例
兴业银行股份有限公司	90%
中海集团投资有限公司	10%
合计	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

官恒秋先生,董事长,硕士学位,高级经济师。曾任兴业银行国际业务部副总经理,兴业银行深圳分行党委副书记、副行长,兴业银行杭州分行党委书记、行长,兴业银行南京分行党委书记、行长,现任兴业基金管理有限公司党委书记、董事长。

明东先生,董事,硕士学位,高级经济师。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输(集团)总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作,历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表,中国远洋运输(集团)总公司/中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总经理、党委委员,中海集团投资有限公司总经理。

胡斌先生,董事,硕士学位,经济师职称。曾任兴业银行乌鲁木齐分行企业金融总部营销管理部总经理,兴业银行总行企业金融总部企业金融营销管理部总经理助理,兴业银行北京分行党委委员、行长助理,兴业银行总行投资银行部副总经理等职务。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理,兼任兴业财富资产管理有限公司执行董事。

李春晖先生,独立董事,博士学位,高级经济师。曾任国泰君安证券股份有限公司总裁助理,国泰基金管理有限公司总经理,执行董事,长江养老保险股份有限公司党委副书记、总裁,上海鼎鼎资产管理公司执行董事,上海保险交易所中保保险资产登记交易有限公司运营管理委员会主任等职。现任杭州华智融科股权投资公司总裁。

陈华锋先生,独立董事,博士学位。曾任加拿大不列颠哥伦比亚大学尚德商学院金融学助理教授,美国德州农工大学梅斯商学院金融学副教授(终身教职),清华大学五道口金融学院讲席副教授(终身教职)。现任复旦大学泛海金融学院教授、博士生导师、MBA项目学术主任。

陈汉文先生,独立董事,博士学位。曾任厦门大学会计学系主任、博士生导师,厦门大学管理学院副院长,厦门大学研究生院副院长等职。现任对外经济贸易大学国际商学院教授。

2、监事会成员

林榕晖先生,监事会主席,博士学位。曾任兴业银行总行计划财务部副总经理、信用审查部总经理、漳州分行党委书记、行长,兴业银行总行运营管理部、风险管理部总经理,战略规划部总经理、企业金融总部副总裁、金融市场总部副总裁等职务。现任兴业银行总行同业金融部总经理。

杜海英女士,监事,硕士学位。曾任中海(海南)海盛船务股份有限公司发展部科长、发展部副主任(主持工作)、发展部主任,其中中海海运(集团)总公司党校副校长,集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理,中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董事长。

郎振宇先生,职工监事,本科学历。曾任天弘基金管理公司广州分公司总经理助理、兴业银行股份有限公司总行资产管理部综合处副处长、兴业基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理等职。现任兴业基金管理有限公司综合管理部总经理。

楼怡斐女士,职工监事,硕士学位。曾任鞍山证券上海管理总部宏观研究员、富国基金交易部交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易部交易总监。现任兴业基金管理有限公司交易部总经理。

3、公司高级管理人员

官恒秋先生,董事长,简历同上。

胡斌先生,总经理,简历同上。

王慧女士,督察长,本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理,兴业银行广州分行副行长,兴业银行信用审查部总经理,兴业银行小企业部总经理,兴业银行金融市场部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生,副总经理,硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长,兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理,兴业银行厦门分行党委委员、行长助理,兴业银行总行投资银行部副总经理,兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张顺国先生,副总经理,本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理,深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理,商人银行部副总经理,深圳发展银行上海分行运营副行长,兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理,兴业基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理,上海兴晟股权投资管理有限公司总经理,兴投(平潭)资本管理有限公司执行董事。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

庄孝强先生,总经理助理,本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财务部副总经理,兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长,兴业银行总行资产管理部总经理助理,兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理,兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

张琦女士,总经理助理,本科学历。历任银华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广东分公司副总经理、渠道部副总经理、营销管理部总经理,市场总监。现任兴业基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

1. 现任基金经理
杨逸君,9年证券从业经历。2010年7月至2013年6月,在海富通基金管理有限公司主要从事基金产品及证券市场分析研究工作;2013年6月至2014年5月在海富通基金管理有限公司主要从事基金产品及量化投资相关的研究工作;2014年5月加入兴业基金管理有限公司,2015年6月至11月担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金和兴业添天盈货币市场基金的基金经理助理。2015年11月9日至2019年6月26日担任兴业稳固收

益两年理财债券型证券投资基金,2015年11月9日起担任兴业添利债券型证券投资基金的基金经理,2015年11月9日至2020年1月21日担任兴业添天盈货币市场基金的基金经理,2015年11月9日至2016年12月12日担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2016年2月25日起担任兴业丰泰债券型证券投资基金基金经理,2016年4月21日至2019年2月14日担任兴业天融债券型证券投资基金基金经理,2016年5月9日起担任兴业天禧债券型证券投资基金基金经理,2016年11月4日起担任中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金基金经理,2016年12月7日至2018年12月6日担任兴业裕华债券型证券投资基金基金经理,2017年1月3日至2019年5月15日担任兴业裕丰债券型证券投资基金基金经理,2017年1月6日至2018年6月5日担任兴业安润货币市场基金基金经理,2017年3月10日至2019年2月14日担任兴业福鑫债券型证券投资基金基金经理,2017年3月23日至2018年12月6日担任兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,2019年11月19日起担任兴业中证银行50金融债指数证券投资基金的基金经理,2020年6月18日起担任兴业上债1-5年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2020年7月3日起担任兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

(2) 历任基金经理

莫华寅,于2017年12月29日至2020年7月14日期间担任兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

5. 投资策略委员会成员

胡斌先生,总经理。
黄文锋先生,副总经理。

冯小波女士,固定收益投资部总经理兼固定收益投资总监。

周鸣女士,基金经理。

徐莹女士,固定收益投资部货币与利率投资团队总监。

滕博先生,固定收益投资部公募债券投资团队副总监。

陈子越先生,固定收益研究部总经理助理。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)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:刘连舸
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人:许俊

传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部门设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金(基金—一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、ODII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、公募基金、资金托管等全门类齐全、品种丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况
截至2019年12月31日,中国银行已托管764只证券投资基金,其中境内基金722只,ODII基金42只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、POF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的重要组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAAF1/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人存在投资指令违反法律法规、行政法规和合同约定的,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,并及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1. 直销机构
(1)名称:兴业基金管理有限公司直销中心
住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
法定代表人:官恒秋
办公地址:上海市浦东新区银城路167号13、14层
联系人:许俊
电话:021-22211967
传真:021-22211997
网址:http://www.cib-fund.com.cn

2. 其他销售机构
其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

(二)登记机构

名称:兴业基金管理有限公司
住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址:上海市浦东新区银城路167号13、14层
法定代表人:官恒秋
设立日期:2013年4月17日
联系电话:021-22211899
联系人:金晨
(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
办公场所: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:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
主要经营场所:上海市延安东路222号外滩中心30楼
执行事务合伙人:付建超
电话:021-6141 8888
传真:021-6335 0003
联系人:汪芳
经办注册会计师:汪芳、侯雯

四、基金的名称

兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值。

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金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。
本基金不参与股票或权证的投资。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前10个工作日至开放期结束后10个工作日内,本基金投资不受前述比例限制。开放期内,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。

九、基金的投资策略

(一)基金的投资策略
本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

1. 封闭期投资策略
(1)资产配置策略
本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、资金供需情况的研究,把握大类资产的预期收益率、利差水平、风险水平,在有效控制风险的基础上,动态调整基金大类资产的投资比例,力争为基金资产获取稳健回报。

(2)久期策略
本基金将通过宏观经济变量和宏观经济政策等进行定性及定量分析,在考虑封闭期剩余期限的基础上,进而对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断。当预期市场利率水平将上升时,适当降低组合的久期;预期市场利率将下降时,适当提高组合的久期。以达到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率的目的。

(3)信用债券投资策略
信用类债券是本基金重要投资标的,信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本基金将根据宏观经济运行情况、行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险,确定信用类债券的信用风险利差,有效管理组合的整体信用风险。同时,本基金将运用本基金管理人比较完善的信用债券评级体系,对信用债券发行人基本面的深入调研分析,结合流动性、信用评级、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

(4)类属配置策略
不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异,债券资产有必要配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置,以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。本基金将综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的结果来决定投资组合的类别资产配置策略。

(5)个券选择策略
本基金根据债券市场收益率水平,在综合考虑债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素的基础上,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在确定投资组合久期之后,本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析,结合税收差异、信用风险分析、利差分析以及交易所流动性分析,判断个券的投资价值,以挑选风险收益相匹配的券种,建立具体的个券组合。

(6)杠杆投资策略
本基金将在考虑债券投资的风险收益情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。

(7)资产支持证券的投资策略
本基金将在综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素的基础上,对资产证券化产品的收益和风险匹配情况等进行定性和定量的全面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能地提高本基金收益。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

(8)中小企业私募债券投资策略
与传统的信用债相比,中小企业私募债券普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金管理人将对中小企业私募债进行详尽的分析,着重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。

2. 开放期投资策略
开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。

(二)基金的投资管理流程

1. 决策依据
(1) 国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;
(2) 以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则;
(3) 国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2. 投资管理程序
(1) 备选库的形成与维护
对于债券投资,分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断,采用利率模型、信用风险模型及期权调整利差(OAS)对普通债券和含权债券进行分析,在此基础上形成基金债券投资的信用储备库。

(2) 资产配置会议
本基金管理人定期召开资产配置会议,讨论基金的资产组合以及个股配置,形成资产配置建议。

(3) 构建投资组合
投资策略委员会在基金合同约定的投资框架下,审议并确定基金资产配置方案,并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资策略委员会的授权下,根据本基金的资产配置要求,参考资产配置会议、投研会议讨论结果,制定本基金的投资策略,在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

(4) 交易执行
基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令向中央交易室发出交易指令,中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(5) 投资组合监控与调整
基金经理负责向投资策略委员会汇报基金投资执行情况,监察稽核部对基金投资进行日常监督,风险管理部负责完成内部的基础业绩和风险评价。基金经理定期对市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估,对基金投资组合不断进行调整和优化。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%。

中债企业债总全价指数和中债国债总全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司(以下简称中债公司)编制并发布。中债企业债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债的整体价格走势和投资回报情况;中债国债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的记账国债的整体价格走势和投资回报情况。这两个债券指数具有较好的市场代表性,能够较好的反映我国企业债市场和国债市场的总体走势。

如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、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。

十一、基金的风险收益特征

本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十二、基金的投资报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,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至2019年12月31日,本报告中所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	固定收益投资	-	-
	其中:债券	3,702,279,000.00	89.61
	资产支持证券	341,019,130.04	8.26
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	34,027,066.01	0.82
8	其他资产	54,009,626.24	1.31
9	合计	4,131,424,832.29	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
本基金本报告期末未持有股票。

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

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	1,327,462,500.00	43.33
	其中:政策性金融债	160,224,000.00	5.23
4	企业债	1,013,889,000.00	33.09
5	企业短期融资券	200,708,000.00	6.56
6	中期票据	946,735,500.00	30.90
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	213,514,000.00	6.97
9	其他	-	-
10	合计	3,702,279,000.00	120.84

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	091900023	19申万安鑫金融债01	2,900,000	290,812,000.00	9.49
2	101803786	18申迪MTN001	1,800,000	183,654,000.00	5.99
3	119151325	19民生丰银行CD255	1,800,000	174,680,000.00	5.70
4	1902211	19国开11	1,600,000	160,224,000.00	5.23
5	101801139	18广光MTN004	1,500,000	152,225,000.00	4.97

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	1988320	19上银安2_b	1,700,000	169,796,000.00	5.54
2	1989263	19国开A2	1,800,000	128,412,000.00	4.19
3	190124	19光明A	300,000	30,929,993.15	1.01
4	1898099	18浦发A2_b	1,600,000	7,312,000.00	0.24
5	156880	18中煤2A	400,000	4,570,136.89	0.15

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

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贵金属。

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
本基金投资范围不包含股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资范围不包含股指期货。