

# 汇添富多策略纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2020年7月31日更新）

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

**重要提示**  
汇添富多策略纯债债券型证券投资基金（基金简称：汇添富多策略纯债；A类份额基金代码：008993；C类份额基金代码：008994；以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2019年9月30日证监许可【2019】1827号文注册募集。本基金基金合同于2020年4月1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。

投资者有风险，投资者根据所持份额享受基金收益，但同时也也要承担相应的投资风险。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，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基金管理人、基金产品的特定风险，等等。本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

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。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，由投资者自行负责。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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者超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本次更新的招募说明书主要涉及财务数据和净值表现内容的更新，更新所载内容截止日为 2020年7月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2020年6月30日。本招募说明书所载财务数据未经审计。

## 一、基金管理人概况

名称：汇添富基金管理股份有限公司  
住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室  
办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼20楼  
法定代表人：李文  
成立时间：2005年2月3日  
批准设立机关：中国证监会  
批准设立文号：证监基金字[2005]15号  
注册资本：人民币132,724,224元  
联系电话：（021）28932888  
股东名称及其出资比例：

股东名称	持股比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海晋冀基金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.056%
上海上投资产管理有限公司	19.906%
东航金融控股有限公司	19.906%
合计	100%

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券股份有限公司资金管理总部副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金融控股有限公司党委书记、副总经理。程峰先生，2016年11月20日担任执行董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口（集团）有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

张晖先生，2015年4月16日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资产管理股份有限公司董事长。历任中银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。林志军先生，2015年4月16日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大Saskatchewan大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学（University of Illinois）国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学（Stanford University）经济系访问学者，加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授（tenured），香港大学商学院访问教授，香港浸会大学商学院会计与法律系教授、博导，系主任。

杨燕青女士，2011年12月19日担任独立董事。国籍：中国，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，国家金融与发展实验室特邀高级研究员、上海政协委员，《第一财经日报》创刊编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学家》等栏目创始人和主持人，《波士堂》《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰·霍普金斯大学访问学者。

魏尚进（Shangjin Wei）先生，2020年1月9日担任独立董事。国籍：美国，加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授，哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授，世界银行顾问，国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

### 2、监事会成员

任瑞良先生，2004年10月20日担任监事，2015年6月30日担任监事会主席。国籍：中国，大学学历，会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上投资产管理有限责任公司副总经理。历任文汇报新民联合报业集团财务中心财务主管，文汇报新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生，2015年9月8日担任监事。国籍：中国，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室负责人。历任中银万国证券计划财务部综合计划部负责人、发展协调部董事会专员，金信证券发展规划部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略部研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生，2015年6月30日担任监事。国籍：中国，国际金融学硕士。现任东航金融控股有限公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008年2月23日担任职工监事。国籍：中国，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金融有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008年2月23日担任职工监事。国籍：中国，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资产管理有限责任公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013年8月8日担任职工监事。国籍：中国，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司电源事业部。

### 3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）  
张晖先生，2015年6月25日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）  
雷晓明先生，2012年3月7日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任中国副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、南京基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资研究、证券投资管理，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理。投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任

厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建信北京开发中心负责人，建信信息技术管理部副总经理，建信信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建信信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015年6月25日担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

## 4、基金经理

刘通先生，国籍：中国。拥有浙江大学金融学硕士学位，9年证券从业经历。2011年7月至2015年8月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益分析师，2015年8月至2019年7月任汇添富基金管理股份有限公司专户投资经理，2020年3月23日至今任汇添富鑫理债券基金、添富鑫泽定开债基金的基金经理，2020年4月1日至至今任汇添富多策略纯债基金的基金经理，2020年6月10日至至今任汇添富多元收益债券的基金经理。

## 5、投资决策委员会

主席：袁建军（副总经理）  
成员：韩贤旺（首席经济学家）、王翔（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

1、基本情况  
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)  
住所：北京市西城区金融大街25号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
法定代表人：田国立  
成立时间：2004年09月17日  
组织形式：股份有限公司  
注册资本：贰仟伍佰亿零玖仟玖佰肆拾柒万肆仟捌佰陆拾陆元整  
存续期间：持续经营  
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号  
联系人：田  
联系电话：(010)6769 5096

中国建设银行股份有限公司于1984年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年末，集团资产规模23.22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,656.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率较加权平均净资产收益率为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持稳中有升。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”、美国《环球金融》“全球最佳金融最具创新能力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得德意志银行、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行协会《2018年“陀螺”评价》中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监察等处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部先后聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 三、相关服务机构

一、基金份额销售机构  
(1) 直销机构  
1) 汇添富基金管理股份有限公司直销中心  
住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室  
办公地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼  
法定代表人：李文  
电话：(021) 28932888  
传真：(021) 50199035或(021) 50199036  
联系人：陈卓甫  
客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）  
邮箱：guitai@tutfund.com  
网址：www.99fund.com  
2) 汇添富基金集团股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

(2) 代销机构  
本基金其他销售机构的具体名单见基金份额发售公告。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示基金销售机构名录。

## 二、登记机构

名称：汇添富基金管理股份有限公司  
住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室  
办公地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼  
法定代表人：李文  
电话：(021) 28932888  
传真：(021) 28932876  
联系人：韩从慧

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  
经办律师：黎明、陈颀华

联系人：陈颀华  
四、审计计基金的会计师事务所  
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层  
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层  
邮政编码：100738  
执行事务合伙人：毛鞍宁  
电话：010-58153000  
传真：010-58188298  
业务联系人：徐旭  
经办会计师：徐旭、许培菁

## 四、基金的名称

本基金名称：汇添富多策略纯债债券型证券投资基金  
基金简称：汇添富多策略纯债  
A类份额基金代码：008993  
C类份额基金代码：008994

## 五、基金的类型

本基金为债券型证券投资基金。

## 六、基金的投资目标

在科学严格管理风险的前提下，本基金力争创造超越业绩比较基准的较高稳健收益。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货，以及法律法规和中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。  
本基金不投资于股票，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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：  
本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金所指的不现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## 八、基金的投资策略

本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场价格趋势，综合运用多种债券投资策略，自上而下决定大类资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括债券资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。

1. 类属资产配置策略  
不同类型的债券，由于受到不同的因素影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同类属债券的投资比例。

2. 利率策略  
本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况 and 金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与凸度综合分析，制定出具体利率策略。

具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合分析主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立经济前景的场景模拟，进而预测财政、货币及政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势与结构，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。

在此基础上，本基金将结合历史与经验数据，区分当期国债收益率曲线的期限利差、曲率与券种利差所面临的历史分位，判断收益率曲线参数变动的程度与概率，即对收益率曲线平移的方向、陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析，以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时，即市场利率将上升，本基金将降低组合久期以规避损失；如出现负向平移的概率较大时，则提高组合久期；如收益率曲线过于陡峭时，则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上，利用蝶形策略获取超额收益。

## 3、信用策略

本基金依靠内部信用评级系统跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，基金管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”-“公司风险”（公司背景+公司行业地位+企业盈利模式+公司治理结构和信息披露状况+企业财务状况）-“外部支持”（外部流动性支持能力+债务担保增信）-“得到评评”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，它是其他定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本基金内部的信用评级体系定位为短期评级，侧重于评级的准确性，从而为信用产品的实时交易提供参考。本基金会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，并快速做出反应，以便及时有效地抓住信用利差变化带来的市场交易机会。

## 4、期限结构配置策略

本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其他合约约束条件的情况下，确定最佳的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

## 5、个券选择策略

本基金建立了自上而下和自下而上两方面的研究流程，自上而下的研究包含宏观基本面对分析、资金技术面分析，自下而上的研究包含信用利差分析、债券信用风险评估、信用估值模型和交易策略分析，由此形成宏观和微观层面相配套的研究决策体系，最后形成具体的投资策略。

## 6、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的投资收益。

在资产支持证券的选择上，本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略。“自上而下”投资策略指在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，本基金运用量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。“自下而上”投资策略指运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

## 7、国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳健增值。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*90%+银行活期存款利率（税后）\*10%。

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：中债综合指数是中国全市场债券指数，以2001年12月31日为基期，基点为100点，并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市場代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债、央行票据等所有主要债券种类。选择中债综合指数作为本基金业绩比较基准的依据的主要理由是：第一，该指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；第二，该指数的样本券覆盖面广，能较好地反映债券市场的整体收益。

如果今后市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的业绩比较基准，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，变更本基金的业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

## 十一、基金投资组合报告

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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年07月17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。

本报告期自2020年04月01日起至06月30日止。

## §1 投资组合报告

### 1.1 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	417,860,126.58	93.69
	其中：债券	373,801,000.00	83.81
	资产支持证券	44,059,126.58	9.88
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
	其中：买入返售金融资产	9,500,134.25	2.13
	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	10,423,371.15	2.34
8	其他资产	8,201,877.76	1.84
9	合计	445,985,509.74	100.00

### 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 1.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 1.4 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	2,001,000.00	0.48
2	央行票据	--	--
3	金融债券	30,908,200.00	7.34
	其中：政策性金融债	21,027,200.00	5.00
4	企业债券	215,461,500.00	51.19
5	企业短期融资券	39,982,000.00	9.50
6	中期票据	85,447,500.00	20.30
7	可转换（可交换）债	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	373,801,000.00	88.81

### 1.5 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	168013	16国开债	200,000	11,940,000.00	2.84
2	110080897	18华靖清源MTN001	100,000	10,490,000.00	2.49
3	143124	17天图01	100,000	10,198,000.00	2.42
4	101801506	18绿城大通MTN001	100,000	10,187,000.00	2.42
5	112856	19美债02	100,000	10,167,000.00	2.42

### 1.6 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	168163	仁恒4优	150,000	15,000,000.00	3.56
2	165692	福耀优	130,000	13,007,600.56	3.09
3	149651	18深银03	100,000	10,051,526.03	2.43
4	168195	惠农01优	60,000	6,000,000.00	1.39

### 1.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 1.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明