

# 嘉实薪金宝货币基金更新招募说明书摘要

(2014年第1号)

## 基金管理人:嘉实基金管理有限公司 基金托管人:中信银行股份有限公司

### 重要提示

本基金根据2014年4月8日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实薪金宝货币市场基金募集的批复》(证监许可[2014]375号)和2014年4月18日《关于嘉实薪金宝货币市场基金募集时间安排的确认函》(证监基金机构部函[2014]31号)的注册公开发售,本基金募集已于2014年12月2日正式生效,自即日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。  
本基金的过往业绩并不预示其未来表现。  
本基金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关系,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并享有基金合同约定的权利,其持有基金份额的行为本身即表明其同意基金合同的承认和接受,并授权(或委托)基金管理人、基金托管人及其他有关当事人享有权利、承担义务。基金投资人了解基金情况时应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金托管人依照恪尽职守、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。  
本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2014年10月29日(特别事项说明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日(未经审计)。

### 一、基金管理人

#### (一)基金管理人基本情况

1.基本情况	
名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元
办公地址	北京市建国门内大街8号华润大厦8层
法定代表人	安泰
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中信信托有限责任公司40%、德意志资产管理(亚洲)有限公司30%、立信投资有限公司30%
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
联系人	胡勇敏

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]6号文批准,于1999年3月25日成立,是中国第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,总部设在北京并设深圳、成都、青岛、济南、杭州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金基金管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。  
嘉实基金管理人无任何处罚记录。

#### (二)主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况  
邓红国先生,董事长,硕士研究生,中共党员。曾任物资部研究室、政策法规司副科长;中国人民银行国际司、外资金融机构管理处、银行监管一司、银行管理局副局长、外司、中国银监会银行监管二部副主任、四部主任;中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014年12月2日起任嘉实基金管理有限公司董事长。  
赵学军先生,董事,总经理,经济学博士,中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所,外经贸部中国进出口总公司,北京商品交易所,天津经济技术开发区、招商局经纪有限公司,北京证券发行有限公司,大成基金管理有限公司,2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。  
苗青先生,董事,学士学位,中共党员。曾任中诚信托有限责任公司国际业务部项目经理、投资管理部业务经理;2004年3月至今任中诚信托有限责任公司投资管理业务经理、副经理、经理、投资总监兼投资管理部部长;现任中诚信托资产与财富管理部、安泰资产管理(Deutsche Asset & Wealth Management, London)全球战略与业务发展部负责人,MD。  
Mark Cullen先生,董事,澳大利亚籍,澳大利亚纽卡斯尔大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易员,贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人,德意志银行(纽约)全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理(纽约)全球首席运营官、MD。  
韩家庆先生,董事,1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海通证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理;2000年11月至今任立信投资有限公司董事长。  
王巍先生,独立董事,美国福特姆大学文理学院金融学硕士、金融学博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行股份有限公司国际研究所助理研究员,美国化学银行分析师,美国世界银行顾问,中国南方证券有限公司副总裁,万隆投资管理有限公司董事长。2004年至今任万隆并购集团董事长。  
张维炯先生,独立董事,中共党员,教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学机械工程系教师,上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。  
汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士。清华大学商法研究所副主任、清华大学法学院副教授,担任中国证券法学研究会常务理事、中国商法学研究会理事、北京市经济法学会常务理事、中国法学会检察学研究会金融检察专业委员会委员、曾任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员,现任上海证券交易所第二屆上市公司委员会委员。  
朱善亮先生,监事,中共党员,硕士研究生。曾任暨南大学经济学院,中国银监会资产管理委员会主任何,国际证券有限责任公司高级经理,中欧基金管理有限公司发展战略部、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

魏柳芳先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教,长安信息产业(集团)有限公司董事会秘书,北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。  
龚继先生,监事,中共党员,博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部,历任人力资源部副经理、副总监、总监。  
曾宪波先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国浩律师事务所(北京)事务证券部律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律部,担任法律部副经理、现任法律部副经理。  
宋振茹女士,副经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫处。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理干部任职处。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任督察员和公司副经理。  
张峰先生,副总经理,中共党员、硕士。曾就职于国家计委,曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部副经理。  
魏京女士,副总经理,武汉大学法学硕士,加拿大大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资管理总部总经理、平安保险集团公司资产管理部副经理兼负责人;平安证券公司助理总经理、平安集团投资管理委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司助理总经理,2008年7月起任公司副经理。  
王炜女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市晋浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。  
邵健先生,副总经理,硕士研究生。历任国泰证券研究所研究员,国泰君安证券行研部副经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。  
李松林先生,副总经理,工商管理硕士。历任元国证券深圳证券部信息总监,南方证券通证部证券部副经理,南方基金运作部副总监,嘉实基金管理有限公司总经理助理。

#### (1)现任基金经理

魏莉女士,金融硕士,CFA,CPA,具有基金从业资格,10年证券从业经历。曾任职于国家开发银行国际金融部,中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金管理有限公司,从事固定收益投资研究工作。2009年1月16日至至今任嘉实鑫利债券基金经理。2009年1月16日至至今任嘉实基金基金经理。2013年12月19日起至今任嘉实薪金宝货币基金经理。2013年12月19日至至今嘉实财富双债基金经理。2013年12月24日至至今任嘉实1个月理财债券基金经理。2014年4月29日至至今任本基金基金经理。

#### (2)历任基金经理

无。  
3.债券投资决策委员会  
本基金采取集体投资决策制度。债券投资决策委员会的成员包括:公司固定收益业务首席投资官魏莉女士、固定收益投资部总监王炜女士、固定收益部负责人万晓西先生、资深基金经理裴晓亮先生、资深投资部副经理林军先生、嘉实国际固定收益投资总监Thomas Wain先生。

#### 4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### (一)基金托管人概况

1.基本情况  
名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)  
住所:北京东城区朝阳门内大街8号富华大厦C座  
办公地址:北京东城区朝阳门内大街8号富华大厦C座  
法定代表人:常振明  
成立时间:1987年4月7日  
组织形式:股份有限公司  
注册资本:467.873亿元人民币  
存续期间:持续经营  
批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅办函[1987]14号  
基金托管资格批准文号:中国证监会证监基金字[2004]125号  
联系人:中信银行资产托管部  
联系电话:010-45658812  
传真:010-65650832  
客服电话:95568  
网址:bank.ecitic.com  
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;经中国银监会、国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。  
中信银行(601988.SH,0998.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融通的城市商业银行,并开创中国现代金融史上多个第一。而随著海内外、伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在国内外金融市场不断成长壮大,于2005年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。

司,同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2017年4月27日,中信银行在上海交易所香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国金)170.32%股权。经过二十多年的发展,中信银行已成为中国资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告。2013年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告。2013年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告。2013年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告。

2.主要人员情况  
李庆萍,行长,高级经济师。1984年8月至2007年1月,任中国农业银行总行国际业务部干部、副处长、处长、副总经理、总经理。2007年1月至2008年12月,任中国农业银行广西分行党委书记、行长。2009年1月至2009年5月,任中国农业银行零售业务总监兼个人业务部、个人信贷业务部总经理。2009年5月至2013年9月,任中国农业银行总行零售业务总监兼个人金融部总经理。2013年9月至2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理。2014年7月,任中国中信股份有限公司副总经理、中信银行行长。  
苏国新先生,中信银行副行长,分管托管业务。曾担任中信集团办公厅副主任,同时兼任中信集团董事长及中信银行董事长秘书。1997年6月开始担任中信集团董事长秘书。1991年8月至1993年10月,在中国农业银行工作。1993年10月至1997年5月在中信集团负责外事工作。1996年1月至1997年1月,在瑞士银行SBC和瑞士联合银行UBS等金融机构工作。  
李松林先生,现任中信银行资产托管部总经理,经济学博士。1996年8月进入本行工作,历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部助理经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理(主持工作)。

3.基金托管业务经营情况  
2004年4月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。  
截至2014年6月30日,中信银行已托管46只开放式证券投资基金及证券公司资产管理产品、信托计划、企业年金、股权基金、ODI等其他托管资产,总托管规模逾370亿元人民币。

### 三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构  
1.直销机构  
(1)嘉实基金管理有限公司直销中心  
办公地址:北京市东城区建国门内大街7号北京富华中心C座12层  
电话: (010)65215588 传真: (010)65215577  
联系人: 赵桂伟  
(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元  
电话: (021)38796558 传真: (021)68880023  
联系人: 陶海彬  
(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司  
办公地址:成都市人民南路一段86号城市之心30H  
电话: (028)86202100 传真: (028)86203210  
联系人: 王莉娟  
(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司  
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场T1-1202  
电话: (0755)25870686 传真: (0755)25870663  
联系人: 陶海彬  
(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司  
办公地址:青岛市市南区香港中路10号国际大厦A座302室  
电话: (0532)66777766 传真: (0532)66777766  
联系人: 陈建林  
(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司  
办公地址:杭州西湖区杭大路15号嘉华国际商务中心313室  
电话: (0571)87759328 传真: (0571)87759331  
联系人: 章文霞  
(7)嘉实基金管理有限公司福州分公司  
办公地址:福州市鼓楼区五四路158号环球广场25层04单元  
电话: (0591)88013673 传真: (0591)88013670  
联系人: 吴志峰  
(8)嘉实基金管理有限公司南京分公司  
办公地址:南京白下区中山东路288号新世纪广场A座4202室  
电话: (025)66671118 传真: (025)66671100  
联系人: 徐莉娟  
(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司  
办公地址:广州市天河区天河北路183号大都会广场2415-2416室  
电话: (020)87555163 传真: (020)81552120  
联系人: 王文桂

2.代销机构  
(1)中信银行股份有限公司  
住所:办公地址:北京市东城区朝阳门内大街8号富华大厦C座  
法定代表人:常振明 联系人: 康奎峰  
电话: bank.ecitic.com 客服电话: 95558  
网址: www.citicbank.com

(2)深圳农村商业银行股份有限公司  
住所:办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路3038号合作金融大厦  
法定代表人:李伟 联系人: 王璇  
电话: 0755-25188269 传真: 0755-25188785  
网址: www.001961200.com 客服电话: 4001260 (深圳) 4001961200(全国)

(3)福建海峡银行股份有限公司  
办公地址:福建省福州市国货南路188号  
注册地址:福建省福州市六一北路158号  
法定代表人:郭运潮 联系人: 吴白玫  
电话: 0591-87838759 传真: 0591-87388016  
网址: www.fjhxbank.com 客服电话: 4008939999

(二)登记机构  
名称:嘉实基金管理有限公司  
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元  
办公地址:北京市建国门内大街8号华润大厦8层  
法定代表人:安泰  
联系人: 郭奕  
电话: (010)65215588  
传真: (010)65185678

(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海源泰律师事务所  
住所:办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼  
负责人:廖海 联系人: 张兰  
电话: (021)51151029-855 传真: (021) 511510398  
经办律师: 刘佳、张兰

(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:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼  
法定代表人:李松林 联系人: 洪磊  
电话: (021)23238888 传真: (021)23238800  
经办注册会计师: 许康祺、洪磊

### 四、基金名称

#### 五、基金的类型

本基金名称:嘉实薪金宝货币市场基金  
本基金类型:契约型开放式  
六、基金的投资目标  
在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。

七、基金的投资范围  
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、通知存款、短期融资券、超短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,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。

八、基金的投资策略  
1.资产配置策略  
根据宏观经济增长(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业失业率、国际间利率水平、汇率等),决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布。  
根据各类资产的流动性特征(主要包括:平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购融资额度等),决定组合中各类资产的投资比例。  
根据各类资产的风险收益及担保状况,决定组合的风险收益结构。  
2.个券选择策略  
在个券选择上,本基金通过定性定量方法,综合分析收益率曲线、流动性、信用风险,评估个券投资价值,发掘出具备相对价值的个券。  
3.银行存款投资策略

本基金根据不同类型的银行存款收益率情况,结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析,以及对整体货币市场利率及其变动趋势的研究,在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。  
4.利用短期市场机会的灵活策略  
由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡;新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方式,积极利用市场机会获得超额收益。  
5.投资决策  
(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  
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市场的判断决定基金的总体投资策略,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(或岗位)提出的报告,并依据基金申购和赎回情况对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;风险管理部门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预警,对基金组合的流动性风险、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。

九、基金的投资业绩  
本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款税后利率  
活期存款是具备最高流动性的存款,本基金期望通过科学严谨的管理,使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益,因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。  
如果今后证券市场中有其他替代货币更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以酌情调整业绩比较基准,但应履行适当程序,并报中国证监会备案,基金管理人应在调整前2日在中国证监会指定媒体上刊登公告,而无须召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征  
本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。  
十一、基金投资组合报告  
基金管理人承诺本基金信息披露不存在虚假记载、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。  
本基金经理人中信银行股份有限公司根据基金合同规定,于2014年10月21日复核了本报告中有关的投资指标、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。  
本基金投资组合报告所载数据截至2014年9月30日(“报告期末”),本报告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	固定收益投资	3,275,322,586.68	44.55
其中:	其中:固定收益投资	3,275,322,586.68	44.55
2	买入返售金融资产	-	-
其中:	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	4,031,409,973.43	54.84
4	其他资产	44,936,449.94	0.61
合计	合计	7,351,669,010.05	100.00

2.报告期末投资组合资产配置情况

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	-	18.45
其中:	其中:买断式回购融资余额	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	1,034,598,686.70	16.39
其中:	其中:买断式回购融资余额	-	-

注:1)报告期末债券回购融资余额为报告期末每日的融资余额的合计数,报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例报告期末每日融资余额占基金资产净值的比例的平均值。  
2)报告期末基金每日债券回购融资余额占基金资产净值的比例报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例的平均值。  
3.基金投资组合平均剩余期限  
(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	110
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	92

注:报告期末每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。  
(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	报告期期末基金资产净值的比例(%)	报告期期末基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	15.32	16.39
其中:	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.95	-
2	30天(含)-60天	34.79	-
其中:	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.59	-
3	60天(含)-90天	34.43	-
其中:	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.72	-
4	90天(含)-180天	4.43	-
其中:	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	26.76	-
其中:	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计	合计	115.73	16.39

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	840,504,187.85	13.31
其中:	其中:政策性金融债	840,504,187.85	13.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,434,818,398.83	38.56
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
合计	合计	3,275,322,586.68	51.88
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债	520,992,894.23	8.25

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和在到期利息。  
5.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

序号	债券代码	债券名称(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	2,600,000	260,550,273.87
2	011451506	14中银债	2,000,000	199,786,777.95
3	014545043	14中银债	1,500,000	150,000,119.19
4	0902055	09国开05	1,000,000	100,413,127.26
5	011474003	14中银债	1,000,000	99,872,047.47
6	071436003	14华安证券	800,000	79,997,152.84
7	071424007	14东兴证券	700,000	69,989,091.32
8	140410	14农发02	600,000	60,132,131.94
9	071431001	14信达证券	600,000	59,989,318.82
10	133036	13国债06	600,000	59,815,971.94

6.“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(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0849%
报告期内偏离度的最低值	-0.0226%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0381%

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十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	2,600,000
2	011451506	14中银债	2,000,000
3	014545043	14中银债	1,500,000
4	0902055	09国开05	1,000,000
5	011474003	14中银债	1,000,000
6	071436003	14华安证券	800,000
7	071424007	14东兴证券	700,000
8	140410	14农发02	600,000
9	071431001	14信达证券	600,000
10	133036	13国债06	600,000

8.基金资产净值变动情况

项目	金额(元)
期初基金资产净值	7,351,669,010.05
本期基金资产净值	7,351,669,010.05
期末基金资产净值	7,351,669,010.05

9.基金资产净值变动情况

项目	金额(元)
期初基金资产净值	7,351,669,010.05
本期基金资产净值	7,351,669,010.05
期末基金资产净值	7,351,669,010.05

10.基金资产净值变动情况

项目	金额(元)
期初基金资产净值	7,351,669,010.05
本期基金资产净值	7,351,669,010.05
期末基金资产净值	7,351,669,010.05

11.基金资产净值变动情况

项目	金额(元)
期初基金资产净值	7,351,669,010.05
本期基金资产净值	7,351,669,010.05
期末基金资产净值	7,351,669,010.05

12.基金资产净值变动情况

项目	金额(元)
期初基金资产净值	7,351,669,010.05
本期基金资产净值	7,351,669,010.05
期末基金资产净值	7,351,669,010.05

13.基金资产净值变动情况

项目	金额(元)
期初基金资产净值	7,351,669,010.05
本期基金资产净值	7,351,669,010.05
期末基金资产净值	7,351,669,010.05

14.