

广发天天红发起式货币市场基金招募说明书(更新)摘要

[2015年第1号]

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
时间:二〇一五年六月
【重要提示】

本基金于2013年10月10日经中国证监会证监许可[2013]1287号文核准。

本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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

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,需充分了解本基金的产品特性,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,由于基金投资人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风险,本基金的特有风险等等。

本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年5月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日(财务数据未经审计)。

第一部分 基金管理人

- 一、概况
- 1.名称:广发基金管理有限公司
- 2.住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
- 3.办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
- 4.法定代表人:王志伟
- 5.成立时间:2003年8月5日
- 6.电话:020-83936666
- 7.全国统一客服热线:95105828
- 8.联系人:段西军
- 9.注册资本:1.2688亿元人民币
- 9.股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司,分别持有本基金管理人5.1135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

- 二、主要人员情况
- 1.董事长:王志伟,经济学硕士,高级职称。兼任中国银行业协会公司治理专业委员会委员,广东省第十届政协委员,广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广发证券董事长兼党委书记、广东发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。
- 林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务部总经理、投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部(总部)副经理、投资银行部常务副总经理。
- 孙晓燕:董事,女,硕士,现任广发证券副总裁、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事,证信银行股份有限公司监事,监事长。曾任广发证券分公司投资银行部副经理、广发证券有限责任公司财务部助理、财务部副总经理、投资运营部副总经理、广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。
- 戈俊:董事,男,管理学硕士,高级经济师。现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火国际技术有限公司、南京烽火滕光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火滕光光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏证信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火天普信息技术有限公司、武汉市烽火微纳科技有限公司、武汉光谷电子科技股份有限公司、成都大唐线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事;兼任烽火光网网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、滕光烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

- 霍美娟:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司有限公司法定代表人,香港集团有限公司总裁,深圳市金海马实业股份有限公司董事长,深圳香江控股股份有限公司董事长。兼任全国政协委员、全国妇联常委、中国产业促进会副会长、广东省工商联副主席、广东省女企业家协会会长、深圳市政协常委、香江社会救助基金会主席、深圳市深商控股集团有限公司董事、广东南粤银行董事,深圳龙岗国安村镇银行董事,广发证券股份有限公司监事。
- 许冬雄:董事,女,工商管理硕士,主管药师,现任康美药业股份有限公司常务副总裁、副总经理,兼任中国中药协会中药饮片专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会委员、全国制药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员、中国医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工专业专家委员会副主任委员、广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。
- 董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海四维乐马律师事务所兼职律师,绍兴银行独立董事,海尔施生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系副主任,复旦大学法学院副院长。

- 姚海鑫:独立董事,男,经济学博士、教授、博士生导师,本人现任辽宁大学新华国际商学院教授,兼任东北制药(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士(MBA)教育中心主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长,新华国际商学院党总支书记。
- 罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任中华联合保险控股股份有限公司常务副总裁,兼任中华联合财产保险股份有限公司总裁(法人代表)。曾任中国人民保险集团公司荆州市分公司经理、中国人民保险湖北分公司业务处长、中国人民保险湖北省国际部总经理、中国人民保险武汉汉口分公司总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险公司总经理助理,太平保险分公司副总经理兼纪委书记,民安保险(中国)有限公司副总经理,阳光财产保险股份有限公司总裁,阳光保险集团执行委员会委员。

- 2.监事会成员
- 余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。
- 匡丽军:监事,女,工商管理硕士,高级涉外秘书,现任广州科技风险投资有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任、广州屈臣氏公司行政主管、广州市实业发展公司办公室主任、总经理,广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。
- 吴晓辉:监事,男,工学硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分公司工会主席。曾任广发证券电脑中心员工、副经理。
- 3.总经理及其他高级管理人员
- 林传辉:总经理,男,大学本科学历,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务部总经理、投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部副总经理、投资银行部常务副总经理。
- 朱平:副总经理,男,硕士,经济师,兼任广发基金管理有限公司量化投资部总经理,中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金汇基金经理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理中心总经理助理。
- 易阳方:副总经理,男,经济学硕士,经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监,中国证券监督管理委员会广东监管局员工、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事、瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理,中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员,广发基金管理有限公司投资管理部总经理,广发基金管理有限公司总经理助理,广发制造业精选股票基金基金经理。
- 段西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。
- 邱春梅:副总经理,男,经济学博士,瑞元资本管理有限公司董事。曾任南方证券资产管理部产品设计人员,广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、产品总监、金融工程部总经理。

- 4.基金经理
- 谭昌杰,男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,7年基金从业经历,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部担任研究员,2012年7月19日起任广发年红债券基金基金经理,2012年9月20日起任广发双债增强型证券投资基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发集鑫债券型证券投资基金和广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日至2015年4月29日任广发季季利债券基金的基金经理,2015年1月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金

经理,2015年3月25日起任广发聚安混合基金的基金经理,2015年4月9日起任广发聚宝混合基金的基金经理。

任爽,女,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,7年基金从业经历,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员,2012年12月12日起任广发地债债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券型证券投资基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年5月30日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理。

5.本基金投资决策集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平,公司副总经理易阳方,权益投资一部总经理刘晓龙,研究发展部副总经理孙迪,固定收益部总经理张丰。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况
名称:广发银行股份有限公司
注册地址:广州市东风东路713号
办公地址:广州市东风东路713号
法定代表人:董建岳
设立日期:1988年7月8日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行银复[1988]292号
组织形式:股份有限公司
注册资本:154.12亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可[2009]363号
联系人:李春磊
联系电话:010-65169830
传真:010-65169556

广发银行股份有限公司成立于1988年,是国务院和中国人民银行批准设立我国首批股份制商业银行之一,总部设于广东省广州市,注册资本154.12亿元。二十多年来,广发银行栉风沐雨,艰苦创业,以自己不断壮大的发展历程,见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2006年,广发银行成功重组,引入了花旗集团、中国人寿、国家电网、中信信托等世界一流的知名企业作为战略投资者。重组后,广发银行紧紧围绕“建设一流商业银行”的战略目标,注重战略规划的执行,坚持“调结构、打基础、抓创新、促发展”,强化风险控制,坚持又好又快可持续发展,取得了良好的经营业绩。截至2013年12月31日,广发银行资产总额7329.21亿元,资产总额14688.50亿元,本外币各项存款余额9949.27亿元,各项贷款余额747.1711亿元。根据英国《银行家》杂志对全球1000家大银行排定的位次,广发银行已连续多年入选全球银行500强。

二、基金托管部及主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部,是从事资产管理业务的专职部门,内设业务运行处、监控管理处、产品营销处和期货业务处,部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格,部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

总经理寻卫国先生具有超过十二年的银行从业经历,先后在中国工商银行和广发银行工作,熟悉我国监管制度和相关行业规则,确保托管业务安全稳健运行。2014年5月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部总经理职务。

三、证券投资基金托管情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务,基金托管业务批准文号:证监许可[2009]363号。截至2012年12月,托管资产规模超1000亿元。建立了一支优秀、专业的托管业务团队,保证了托管服务水平在行业的领先地位。建立了完善的的产品线,产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等,能为产品托管提供全面服务。

第四部分 相关服务机构

- 一、基金份额发售机构
- 1.广发基金管理有限公司直销中心
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东塔楼4楼
直销中心电话:020-89899071 020-89899042
传真:020-89899069 020-89899070
网址:www.gffunds.com.cn
- 2.广发基金管理有限公司网上直销系统(网址:www.gffunds.com.cn)
- 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基金,并及时公告。
- 二、注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
法定代表人:王志伟
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华
- 三、出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师(广州)事务所
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦C楼
负责人:程鲁
电话:020-38799345
传真:020-38799035
经办律师:黄丹、周珊珊
联系人:程鲁
- 四、审计基金资产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯恒
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:王明静、吴迪

第四部分 基金名称

第五部分 基金类型

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。

第七部分 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金融工具,具体如下:

1. 现金;
2. 通知存款;
3. 短期融资券(包括超短期融资券);
4. 1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;
5. 期限在1年以内(含1年)的债券回购;
6. 剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
7. 剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
8. 剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据;
9. 期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
10. 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规及监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

一、基金的投资策略
本基金将在深入研究国内外宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。

(一)利率预期策略
影响利率走势的因素很多,影响短期利率变化的因素更多,运行方式也更为复杂。基金管理人将重点考察以下两个因素:

1.中央银行、财政部等国家宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场走向的影响非常深远。国家宏观经济管理部门尤其是中央银行对经济运行形势的判断及采取的应对政策是影响市场利率走势的关键因素之一。

2.短期资金供求变化。短期资金市场参与者的头寸宽紧程度是短期利率变动的重要主导力量。短期利率随短期资金供求变化呈一定的季节波动形态。

具体而言,本基金管理人将持续跟踪反映国民经济变化的宏观经济指标,对国家经济政策进行深入分析,进而对短期利率的变化态势做出及时反应。重点关注宏观经济指标包括:国家宏观经济管理部门政策、预期物价指数、相关市场资金供求关系等等。

在分析方法上,本基金管理人坚持定性定量相结合的分析方法。

(二)期限配置策略
在短期利率期限结构分析的基础上,根据对投资对象流动性和收益性的动态考察,构建短期期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般说来,预期利率上涨时,将适当缩短组合的平均期限;预期利率下降时,将在法律法规允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

(三)品种配置策略
在短期利率期限结构分析和品种深入分析的基础上,进行品种合理

配置。当预期利率上涨时,可以增加回购资产的比重,适度降低债券资产的比重;预期利率下降,将降低回购资产的比重,增加债券资产的比重。

(四)银行定期存款及大额存单投资策略

银行定期存款及大额存单是本基金的主要投资对象,因此,银行定期存款及大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。具体而言,在组合投资过程中,本基金将在综合考虑成本收益的基础上,尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围,通过这些银行广泛、耐心而细致的询价,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款及大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。

(五)套利策略

在久期控制的基础上,本基金管理人将对货币市场的各个细分市场进行深入研究分析,在严格控制风险和保障流动性的前提下,寻找跨市场、跨期限、跨品种的套利投资机会,以期获得更高的收益。当然,由于交易机制的限制,目前跨套利投资机会的投资方法主要是用风险较低,但收益更高的品种替代收益较低的品种,或者用收益相当,风险较低的品种替代风险较高的品种。

(六)流动性管理策略

流动性好是货币市场基金的重要特征之一。在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。

具体而言,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性资产、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡配置,以满足日常的基金资产变现需求。

二、投资决策依据和投资程序

(一)投资决策依据

1.国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

2.宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。

(二)投资决策程序

1.投资决策委员会制定整体投资策略。

2.固定收益部研究员根据自身或者其他研究机构的研究成果,形成利率走势预测、券种配置建议等,为投资决策提供支持。

3.固定收益基金基金经理根据投资决策委员会的投资策略,结合研究员的研究报告,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、目标久期、期限结构、个券选择等投资方案。

4.投资决策委员会对固定收益基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决议纪要。

5.根据决议纪要,固定收益基金基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易部执行。

6.中央交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈至基金经理小组。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始执行。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行根据本基金合同规定,于2015年5月15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至2015年3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	固定收益投资	7,803,255,956.60	41.30
	其中:债券	7,803,255,956.60	41.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,479,154,662.65	7.83
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	90,500,699.00	0.48
3	银行存款和结算备付金合计	9,388,861,537.29	49.70
4	其他各项资产	220,892,481.72	1.17
5	合计	18,892,164,638.26	100.00

2 报告期末债券回购融资情况

序号	报告期内债券回购融资余额		
1	报告期内债券回购融资余额		12.37
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,927,276,515.78	11.37
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期末投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布情况

序号	平均剩余期限	报告期资产占基金资产净值比例(%)	报告期负债占基金资产净值比例(%)
1	30天以内	33.69	11.37
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	18.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	20.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	19.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	18.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.44	11.37

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	国债资产	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	960,124,427.09	5.66
	其中:政策性金融债	960,124,427.09	5.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,843,131,529.51	40.36
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	7,803,255,956.60	46.03
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011502001	15铁道SCP001	2,000,000	199,860,964.04	1.18
2	011510003	15中电SCP003	2,000,000	199,628,387.22	1.18
3	120219	12国开19	1,800,000	180,034,749.69	1.06
4	011461009	14中广SCP009	1,600,000	160,099,870.54	0.94
5	140429	14农发29	1,500,000	150,041,839.59	0.89
6	120407	12农发07	1,500,000	150,007,705.32	0.88
7	011424006	14广治SCP006	1,400,000	139,972,635.62	0.83
8	140443	14农发43	1,300,000	130,162,301.25	0.77
9	011537003	15中债1	1,300,000	129,679,874.72	0.76
10	011508002	15年银聚SCP002	1,200,000	119,896,456.28	0.71

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占0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1192%
报告期内偏离度的最低值	-0.0144%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0774%

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8 投资组合报告附注

8.1基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

8.2本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

8.3本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	52,339,215.07
3	应收利息	168,553,266.65
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	220,892,481.72

第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,