

国投瑞银增利宝货币市场基金招募说明书摘要

(2015年6月更新)

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：渤海银行股份有限公司

【重要提示】

本基金经中国证监会2014年10月24日证监许可[2014]1125号文注册募集。本基金基金合同于2014年11月13日正式生效。

基金管理人保证本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，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持份额享受基金收益，但同时也要承担相应的投资风险。影响证券价格波动的因素主要有：财政与货币政策变化、宏观经济周期变化、利率和收益率曲线变化、通货膨胀风险、债券发行人的信用风险、公司经营风险以及政治因素的变化等；此外，还包括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中实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特有风险。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况变动导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金投资于货币市场工具，包括现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券（国债、金融债、公司债、企业债、次级债等）、期限在1年以内（含1年）的债券回购、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据、剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人管理的其他基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2015年5月13日，其中投资组合报告与基金业绩数据截止日期为2015年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。本基金托管人渤海银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”或“渤海银行”）于2015年6月8日对本招募说明书摘要（2015年6月更新）进行了复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国投瑞银基金管理有限公司
英文名称：UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD
住所：上海市虹口区东大名路638 号7 层
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人：叶柏寿
设立日期：2002年6月13日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】25号
组织形式：有限责任公司
注册资本：壹亿元人民币
存续期限：持续经营
联系人：杨熹
客服电话：400—880—6868
传 真：（0755）82904048
股权结构：

股东名称	持股比例
国投证券信托有限公司	51%
瑞士银行股份有限公司(UBS AG)	49%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

叶柏寿先生，董事长，中国籍，经济学学士，现任国家开发投资公司副总经理、国投资产控股有限公司副董事长（法定代表人）、国投资产有限公司董事、国投电力控股股份有限公司监事会主席、国投融资租赁有限公司董事长。曾任国家计委经济研究所干部、研究室副主任，国家开发投资公司财务会计部干部、处长、副主任、主任。

凌新强先生，董事，中国籍，硕士，高级经济师。现任瑞士银行（香港）环球资产管理公司董事总经理，中国区主席。曾任华夏基金管理有限公司董事长、北京证券有限公司董事长、华夏证券有限公司执行副总裁、中国钢铁工贸集团公司总裁助理，中国冶金进出口总公司总裁助理，北京国际信托投资公司业务部副经理。

王彬女士，董事，中国籍，硕士，高级经济师。现任国投泰康信托有限公司副总经理兼董事会秘书。曾任国投瑞银基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书，国投信托有限公司资产管理部经理，北京国际电力开发投资公司、北京康能热电股份有限公司董事会秘书。

董日成先生，董事，中国香港籍，英国Sheffield大学学士。现任瑞银环球资产管理公司中国区董事总经理。曾任瑞银环球资产管理中国区业务经理、执行董事，瑞银环球资产管理对冲基金亚太区首席营运官，瑞银环球资产管理台湾总经理，香港瑞银财富管理部门主管，国投瑞银基金管理有限公司代总经理和首席营运官，美林投资经理人公司亚太区首席营运官，美国国际集团亚太地区的金融及营运领域担任多个重要职务等。

刘纯亮先生，总经理，董事，中国籍，经济学学士，中国注册会计师协会和特许公认会计师公会（ACCA）会员，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长及国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事长。曾任北京建工集团总公司会计，柏德豪（BDO）关黄陈方国际会计师事务所会计师，中国证券监督管理委员会稽查部科员，博时基金管理有限公司监察法律部负责人、督察长，国投瑞银基金管理有限公司副总经理。

李哲平先生，独立董事，中国籍，金融学硕士，现任当代金融家杂志社主编、中信银行独立董事、中航证券有限公司独立董事。曾任统信资产评估公司董事长、中国投资理论论坛主编，中国金融培训中心助教。

史克通先生，独立董事，中国籍，法学学士，现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人、律师，主要从事公司经常性业务及IPO、上市公司再融资及重大重组、证券投资基金及私募基金的设立、投资等业务；兼任中国证证控股有限公司独立董事。曾任职于山东鲁中律师事务所、北京市京都律师事务所。

龙海先生，独立董事，中国籍，硕士。现任北京海问投资咨询有限公司董事长，中央财经大学会计系副教授，兼任庆铃汽车股份有限公司和北展实业股份有限公司独立董事。曾任华夏基金管理有限公司独立董事，曾在毕马威国际会计组约分部担任审计和财务分析工作。

2、监事会成员

卢永梁先生，监事会主席，中国香港籍，工商管理硕士，现任瑞银环球资产管理公司中国区财务部主管和瑞银环球资产管理(中国)有限公司监事。曾任瑞银环球资产管理公司泛亚地区财务部主管。以往在金融服务及电信行业担任多个财务部管理职位。

展飞先生，监事，中国籍，硕士，现任国投泰康信托有限公司固有业务总部负责人。曾任国家开发投资公司战略发展部一级项目经理助理，国投信托有限公司信托资产运营部和信托资产管理部项目经理。

王明辉先生，监事，中国籍，经济学硕士，特许金融分析师协会会员、全球风险协会会员，拥有特许金融分析师(CFA)、金融风险管理师(PRM)、国际注册会计师(CIA)资格。现任国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部总监。曾任任职国投瑞银基金管理有限公司监察稽核部副总监、国泰君安证券股份有限公司稽核审计总部审计总监。

冯伟女士，监事，中国籍，经济学硕士，高级会计师。现任国投瑞银基金管理有限公司总经理助理。曾任职中融基金管理有限公司清算主管、深圳投资基金管理有限公司投研人员。

3、公司高级管理人员及督察长

刘纯亮先生，总经理，董事，中国籍，经济学学士，中国注册会计师协会和特许公认会计师公会（ACCA）会员，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事长及国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事长。曾任北京建工集团总公司会计，柏德豪（BDO）关黄陈方国际会计师事务所会计师，中国证券监督管理委员会稽查部科员，博时基金管理有限公司监察法律部负责人、督察长，国投瑞银基金管理有限公司副总经理。

王书鹏先生，副总经理，中国籍，北京航空航天大学工程硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司总经理及董事。曾任任职内蒙古哲盟交通规划设计院，内蒙古自治区交通厅公路局规划分局，北京拓宇交通通用设备制造有限公司财务经理，和安达信隆会计师事务所项目经理，国投信托资产管理部财务、信托资产运营管理部经理。

包爱丽女士，副总经理，中国籍，美国哥伦比亚大学硕士，兼任国投瑞银资产管理（香港）有限公司董事。曾任贝莱德资产管理有限责任公司资产管理核算部、共同基金业务主管，银华基金管理有限公司战略发展部总监，国投瑞银基金管理有限公司产品及业务拓展部总监、总经理助理、督察长。

张南森先生，副总经理，中国籍，北京大学高级管理人员工商管理硕士。曾任湘财证券有限公司营业部总经理助理，银华基金管理有限公司市场营销部执行主管，中邮创业基金管理有限公司机构理财部副总经理，国投瑞银基金管理有限公司机构服务部总监、总经理助理。

刘凯先生，督察长，中国籍，复旦大学工商管理学硕士，兼任国投瑞银资本管理有限公司董事。曾任尊荣集团证券投资项目经理，君安证券东门南营业部研究员，平安证券蛇口营业部投资顾问，招商基金管理有限公司客户服务部总监，国投瑞银基金管理有限公司市场部总监、总经理助理。

4、本基金基金经理

徐栋，中国籍，北京大学经济学硕士，香港大学金融硕士。注册会计师协会(CICPA)非执业会员，特许金融分析师(CFA)协会会员。6年证券从业经历。2009年7月加入国投瑞银基金管理有限公司，从事固定收益研究工作。2012年9月20日至2014年10月28日期间担任国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金及国投瑞银货币市场基金基金经理助理，2013年4月2日至2014年10月28日期间担任国投瑞银稳定增利债券型证券投资基金基金经理助理。2013年12月26日起任国投瑞银货币市场基金基金经理，2014年3月22日起兼任国投瑞银货币市场基金基金经理，2014年10月17日起兼任国投瑞银钱多宝货币市场基金基金经理，2014年11月13日起兼任国投瑞银增利宝货币市场基金基金经理，2015年1月20日起兼任国投瑞银双债增利债券型证券投资基金基金经理。

颜文治，中国籍，英国莱斯特大学金融经济学硕士。5年证券从业经历。2010年10月加入国投瑞银基金管理有限公司交易部，2013年7月转岗固定收益部，2014年6月11日至9月1日期间担任国投瑞银成长优选股票、融华债券、策略行业混合、核心企业股票、创新驱动股票、稳健增长混合、新兴产业混合、景气精选混合、医疗保健混合、货币市场基金、瑞易货币基金的基金经理助理。2014年9月2日起任国投瑞银货币市场基金基金经理，2014年10月30日起兼任国投瑞银钱多宝货币市场基金基金经理，2014年12月4日起兼任国投瑞银增利宝货币市场基金基金经理，2015年4月23日起兼任国投瑞银添利宝货币市场基金基金经理。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

（1）投资决策委员会召集人：刘纯亮先生，总经理
（2）投资决策委员会成员：
李怡文女士：固定收益部副总监，基金经理
何明女士：研究部总监
蒋旭东先生：交易部助理，量化投资部负责人
杨俊先生：交易部总监
马少章先生：专户投资部副总监，投资经理
汤海波先生：国际业务部副总监，基金经理
陈小玲女士：基金投资部副总监，基金经理
（3）总经理和督察长列席投资决策委员会会议。
6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：渤海银行股份有限公司（简称“渤海银行”）
住所：天津市河西区马场道201—205号
办公地址：天津市河西区马场道201—205号
法定代表人：刘宝凤
成立日期：2006年12月30日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币捌拾伍亿元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2010]893 号
联系人：马晓冬
联系电话：022-58555917

发展概况：渤海银行是1996 年以来获国务院批准新设立的第一家全国性股份制商业银行，是第一家在发起设立阶段就引入境外战略投资者的中资商业银行，也是第一家总部设在天津的全性股份制商业银行。渤海银行由天津泰达投资控股有限公司、渣打银行（香港）有限公司、中国远洋运输（集团）总公司、国家开发投资公司、宝钢集团有限公司、天津信托有限责任公司和天津信托投资（控股）有限公司等7家股东发起设立，注册资本总额85亿元人民币。2005年12月30日成立，2006年2月正式对外营业。

在英国《银行家》杂志2014年公布的全球银行1000 强排名中，渤海银行排名230 位，较上年提升48名；在《亚洲银行家》杂志2014年度亚洲银行家500强资产排名及实力排名中，渤海银行分获第63名及第49名，较上年提升11名及3名；2014年，在各类机构组织的一系列评选活动中，渤海银行先后获得“最具成长性全国性商业银行奖”、“年度最值得信赖银行奖”、“年度最佳金融创新银行奖”、“年度优秀金融品牌奖”等多项殊荣。

（二）主要人员情况

付刚训先生，男，1959年3月出生，高级经济师，博士研究生，毕业于东北财经大学，现任渤海银行股份有限公司党委副书记、行长，全国“五一”劳动奖章、全国金融系统“五一”劳动奖章获得者，南开大学、东北财经大学金融系兼职教授。曾任辽宁省锦州市财政局财务处处长、辽宁省锦州经济技术开发区管委会党委委员、副主任，交通银行锦州分行副行长，交通银行营口分行党委书记、行长，交通银行福州分行党委书记、行长，交通银行天津市分行党委书记、行长。孙利国先生，渤海银行副行长、分管托管业务。曾长期任职于中国建设银行，2003年12月起参加渤海银行筹建工作，2005年12月起任渤海银行董事会秘书，2009年12月起任渤海银行副行长、董事会秘书。

赵亚萍女士，渤海银行托管业务部总经理，29年金融从业经历，具有丰富的托管业务管理经验，曾任中国农业银行信托投资公司信贷员、部门副经理、部门经理，中国农业银行基金托管部资金清算处处长、核算处兼市场部处长，天弘基金管理有限公司副总经理，2007年起任渤海银行托管业务部总经理。

渤海银行总行设托管业务部，下设市场营销、托管运作、稽核监督、需求与运维四个团队，配备有人员共34名。部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，高管人员和团队负责人均具备研究生以上学历。

（三）基金托管业务经营情况

渤海银行于2010年6月29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，2011年5月3日获得中国保监会核准开办保险资金托管业务。渤海银行始终秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，严格履行资产托管人职责，为投资者和金融资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，并依据不同客户的需求，提供个性化的托管服务和增值服务，获得了合作伙伴一致好评。目前，渤海银行托管业务已涵盖信托计划保管、商业银行理财产品托管、证券投资基金托管、基金管理公司特定客户资产管理托管、证券公司客户资产管理托管、股权投资基金托管、保险资金托管、客户资金托管等业务品种。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构：国投瑞银基金管理有限公司直销中心
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人：叶柏寿
电话：(0755)83575993 83575992
传真：(0755)82904048 82904007
联系人：曹丽丽、杨熹
客服电话：400—880—6868
网站：www.ubssdic.com
2、代销机构
（1）渤海银行股份有限公司
住所：中国天津市河西区马场道201—205号
办公地址：中国天津市河西区马场道201—205号
法定代表人：刘宝凤
联系人：王宏
电话：（022）58316666
传真：（022）58316669
客服电话：400—888—8811
网站：www.cbhb.com.cn
其他代销机构情况详见本基金基金份额发售公告。

3、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，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：国投瑞银基金管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路638号7层
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人：叶柏寿
联系人：冯伟
电话：（0755）83575836
传真：（0755）82912534
（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
注册地址：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
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
经办律师：廖海、刘佳
联系人：刘佳
（四）会计师事务所和经办注册会计师
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16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16层
执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：（010）58153000、（0755）25028288
传真：（010）85188298、（0755）25026188
签字注册会计师：昌华、高嵩
联系人：昌华

四、基金的名称

本基金名称：国投瑞银增利宝货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型：货币市场基金
基金运作方式：契约型、开放式

六、基金的投资目标

本基金以基金资产安全性、流动性为先，并力争实现超越业绩比较基准的收益。
七、基金的投资方向
本基金主要投资于以下金融工具：现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券（国债、金融债、公司债、企业债、次级债等）、期限在1年以内（含1年）的债券回购、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据、剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金主要采用流动性管理策略、资产配置策略，并适当利用交易策略，进行积极的投资组合管理。

（一）流动性管理策略

流动性管理是本基金投资管理过程中的首要事项。对此，本基金首先将结合申购、赎回现金流的预测，对投资组合的剩余期限进行合理搭配并适当采用滚动投资策略，即采用均匀资金量、持续滚动投资的方法，使得投资组合中自 naturally 到期的现金流在时间上均匀化，从而更好地满足日常流动性需要。

其次，本基金在确定各投资标的的具体投资量时，将充分考虑其流动性情况（交易方式、日均成交量和平均每笔成交间隔时间等），以确定适当的配置比例，确保基金资产保持良好的变现能力。

（二）资产配置策略

1、整体配置策略
通过宏观经济形势、财政货币政策和短期资金市场参与者的资金供求状况等因素的深入分析，对短期利率走势进行合理预计，并据此以调整投资组合平均到期期限为主的资产配置策略。当预期短期利率呈下降趋势时，本基金将侧重配置期限相对稍长的短期金融工具；反之，则侧重配置期限相对较短的金融工具。

2、类别资产配置策略

本基金根据对不同类别资产的收益率水平（各剩余期限到期收益率、利息支付方式 and 再投资便利性），并结合各类资产的流动性特征和风险特征（信用等级、波动性）等，在流动性要求约束下追求收益最大化，以此确定各类资产的配置比例和期限分布结构。

3、明细资产配置策略

本基金将综合考量明细资产的剩余期限、信用等级、收益率情况，判断其投

资价值，并充分考虑明细资产流动性情况，决定具体投资量。

（三）套期策略

除上述主要策略外，在有效控制资产安全性和流动性的基础上，本基金还将通过深入分析货币市场运作特点，审慎运用套利策略、峰值策略，以增强基金收益：

1、套利策略

不同交易市场或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素差异化影响而出现定价差异，从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，适度进行跨市场或跨品种套利操作，提高资产收益率。

2、峰值策略

在特定时点或事件驱动下，货币市场出现短期资金供求失衡、短期利率上升时，本基金将把握资金供求的瞬时效应，积极捕捉收益率峰值的短线交易机会。

九、基金的业绩比较基准

七天通知存款利率（税后）。
通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取中国人民银行公布并执行的同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

在对份额持有人利益产生实质性不利影响的情况下，如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人可以在与基金托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

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。

（一）报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	296,983,406.79	25.91
其中：债券	296,983,406.79	25.91	
资产支持证券	—	—	
2	买入返售金融资产	121,495,862.24	10.60
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	723,041,923.28	63.07
其他资产	4,877,242.62	0.43	
5	合计	1,146,398,434.93	100.00

（二）报告期末债券回购融资情况

1、债券回购融资基本情况

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比例的简单平均值。

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

（三）基金投资组合平均剩余期限

项目		天数
报告期末投资组合平均剩余期限		69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值		89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值		29

注：本基金基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不超过120天。本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天的情况。

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	64.99	4.96
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债务	—	—	—
2	30天(含)—60天	3.67	—
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债务	—	—	—
3	60天(含)—90天	18.78	—
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债务	—	—	—
4	90天(含)—180天	2.44	—
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债务	—	—	—
5	180天(含)—397天(含)	14.66	—
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债务	—	—	—
合计		104.54	4.96

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元			
序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	60,239,994.33	5.52
其中：政策性金融债	60,239,994.33	5.52	
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	236,743,412.46	21.68
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	296,983,406.79	27.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

（五）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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	110212	11国开12	200,000	20,095,353.82	1.84
2	110402	11农发02	200,000	20,087,766.62	1.84
3	041451055	14农发CP004	200,000	20,067,079.72	1.84
4	041556004	15农发CP001	200,000	20,040,422.04	1.84
5	041552012	15农发四CP001	200,000	20,000,144.43	1.83
6	041552010	15农发四CP002	200,000	20,000,140.73	1.83
7	071522001	15齐鲁证券CP001	200,000	19,999,845.18	1.83
8	071541002	15恒丰CP02	200,000	19,995,437.46	1.83
9	041561007	15开滦CP01	200,000	19,993,965.06	1.83
10	041562011	15鲁农CP001	200,000	19,990,836.71	1.83

（六）“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	0.0252%
报告期内偏离度的最低值	-0.0144%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.00623%

（七）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。

（八）投资组合报告附注

1、基金计价方法说明。