

# 信息披露 Disclosure

(上接B057版)

法定代表人:卓毓磊  
联系人:王妮萍  
联系电话:0756-33376853  
业务传真:0756-33065516  
客服热线:4006877899  
公司网址:www.tenynyfund.com  
(68) 名称:中期时代基金销售(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号  
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层  
法定代表人:路瑶  
联系人:侯英健  
联系电话:010-65808756  
业务传真:010-65807864  
客服热线:95162、400888160  
公司网址:www.CIFCO-FUND.com  
(69) 名称:万银财富(北京)基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201  
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201  
法定代表人:李招弟  
联系人:高晓芳  
联系电话:010-59393923  
业务传真:010-59393074  
客服热线:400-808-0069  
公司网址:www.wy-fund.com  
(70) 名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城大厦68号时代金融中心8楼  
法定代表人:汪静波  
联系人:方成  
联系电话:021-38600735  
业务传真:021-38509777  
客服热线:400-821-5399  
公司网址:www.noah-fund.com  
(71) 名称:上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼  
法定代表人:其实  
联系人:潘世友  
联系电话:021-54509988  
业务传真:021-64385308  
客服热线:4001818188  
公司网址:www.1234567.com.cn  
(72) 名称:杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号  
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈柏青  
联系人:张裕  
联系电话:021-60897840  
业务传真:0571-26697013  
客服热线:400-676-1213  
公司网址:www.fund123.cn  
(73) 名称:和讯信息科技有限公司  
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人:王莉  
联系人:吴阿婷  
联系电话:0755-82721106-8642  
业务传真:0755-82029055  
客服热线:4009200022  
公司网址:www.hexun.com  
(74) 名称:浙江金观诚财富管理有限公司  
注册地址:浙江杭州市西湖区世贤丽晶城欧美中心1号楼(D区)  
办公地址:浙江杭州市西湖区世贤丽晶城欧美中心1号楼(D区)  
法定代表人:陆彬彬  
联系人:邓秀勇  
联系电话:0571-56028620  
业务传真:0571-56899710  
客服热线:400-608-0058  
公司网址:www.jincheng-fund.com  
(75) 名称:东兴证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)  
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)  
法定代表人:魏庆华  
联系人:汤漫川  
联系电话:010-66555316  
业务传真:010-66555246  
客服热线:4008888993  
公司网址:www.dxzq.net.cn  
(76) 名称:北京钱景财富投资管理有限公司  
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
法定代表人:赵荣春  
联系人:魏新  
联系电话:010-57418829  
业务传真:010-57569671  
客服热线:400-678-5095  
公司网址:www.niuju.net  
(77) 名称:上海久富财富管理有限公司  
注册地址:上海市浦东新区莱阳路2819号1幢1009室  
办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室  
法定代表人:赵惠博  
联系人:徐金华  
联系电话:021-69858525  
业务传真:021-69882297  
客服热线:400-021-9898  
公司网址:www.jfcta.com  
(78) 名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#  
办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层  
法定代表人:杨茜  
联系人:张燕  
联系电话:010-58325388-1588  
业务传真:010-58325322  
客服热线:400-166-1182  
公司网址:http://8.jrj.com.cn  
(79) 名称:大同证券有限责任公司  
注册地址:大同市城区迎宾路15号桐城中央21层  
办公地址:山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层  
法定代表人:董祥  
联系人:薛津  
联系电话:0351-4130322  
业务传真:0351-4137986  
客服热线:4007121212  
公司网址:www.dtscc.com.cn  
(80) 名称:中国国际期货有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层  
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层  
法定代表人:王兵  
联系人:赵燕  
联系电话:010-59639864  
业务传真:010-59639886  
客服热线:95162、400-8888-160  
公司网址:www.cifco.com  
(81) 名称:北京明天泽基金销售有限公司  
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室  
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层  
法定代表人:梁斌  
联系人:陈晔  
联系电话:010-57756019  
业务传真:010-57756019  
客服热线:400-756-8898-5  
公司网址:www.chtfund.com  
(82) 名称:嘉实财富管理有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京朝阳区建国路91号金地中心A座6层  
法定代表人:朱军铭  
联系人:景琪  
电话:021-20289890  
传真:021-20280110  
网址:www.harvestwm.cn  
客服电话:400-021-8850  
(83) 名称:北京创金壹信投资管理有限公司  
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A  
法定代表人:梁睿  
联系人:张晶晶  
联系电话:010-66154828-809  
业务传真:010-88067526  
客服热线:010-66154828  
公司网址:www.51rich.com  
(84) 名称:宜信普信资产管理顾问(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809  
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809  
法定代表人:沈伟彬  
联系人:程刚  
联系电话:010-52855713  
业务传真:010-85894295

客服热线:400-6099-200  
公司网址:www.yixinfund.com  
(85) 名称:中经北证(北京)资产管理有限公司  
公司简称:中经北证  
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
法定代表人:徐福星  
联系人:陈莹莹  
联系电话:13261320700  
业务传真:010-88381550  
客服热线:010-68998820  
公司网址:www.bzfunds.com  
(86) 名称:一路财富(北京)信息科技有限公司  
公司简称:一路财富  
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702  
办公地址:北京市西城区阜成门内大街2号万通新世界广场A座22层  
法定代表人:吴雪秀  
联系人:刘栋栋  
联系电话:010-88312877-8009  
业务传真:010-88312099  
客服热线:400-001-1566  
公司网址:www.yilucaifu.com  
(87) 名称:中经北证(北京)资产管理有限公司  
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号新华1949产业园东门  
法定代表人:徐福星  
联系人:陈莹莹  
联系电话:13261320700  
业务传真:010-88381550  
客服热线:010-68998820  
公司网址:www.tdyfund.com  
(88) 名称:厦门市鑫鼎盛控股有限公司  
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504  
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504  
法定代表人:林松  
联系人:李智磊  
联系电话:0592-3122679  
业务传真:0592-8060771  
客服热线:0592-3122731  
公司网址:www.xds.com.cn  
(89) 名称:北京唐鼎耀华投资咨询有限公司  
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室  
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303  
法定代表人:王岩  
联系人:胡明会  
联系电话:010-59200855  
业务传真:010-59200800  
客服热线:400-819-9868  
公司网址:www.tdyfund.com  
(90) 名称:中债建投资产管理(北京)有限公司  
注册地址:北京市西城区中山路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A、8-B4、9-B、C  
办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼  
法定代表人:彭文德  
联系人:刘芸  
联系电话:023-86769637  
业务传真:023-86769629  
客服热线:400-8877-780  
公司网址:www.cfc108.com.cn  
(91) 名称:海银基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元  
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼  
法定代表人:刘惠  
联系人:刘艳妮  
联系电话:021-80133827  
业务传真:021-80133413  
客服热线:400-808-1016  
公司网址:www.fundhaiyin.com  
(92) 名称:北京恒久浩信投资管理有限公司  
注册地址:北京市怀柔区北口镇北韩村808号  
办公地址:北京市朝阳区光华路7号汉城大厦15B5(西区15层)  
法定代表人:谢凡凡  
联系人:陈冲  
联系电话:010-88580321  
业务传真:010-88580366  
客服热线:4006-525-676  
公司网址:www.haofunds.com  
(93) 名称:北京展恒基金销售有限公司  
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号  
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层  
法定代表人:闫振杰  
联系人:翟飞飞  
联系电话:010-52703350-6006  
业务传真:010-62020355  
客服热线:4008886621  
公司网址:www.myfund.com  
(94) 名称:上海利得基金销售有限公司  
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室  
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  
法定代表人:沈健群  
联系人:张裕  
联系电话:158081816961  
客服热线:4000676266  
公司网址:www.leadfund.com.cn  
(95) 名称:徽商期货有限责任公司  
注册地址:合肥市芜湖路258号  
办公地址:合肥市芜湖路258号  
法定代表人:吴国华  
联系人:蔡芳  
联系电话:0551-62862801  
业务传真:0551-62862801  
客服热线:4008878707  
公司网址:www.hsqh.net  
3.其他代销机构  
本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另另行公告。  
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,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三路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:国浩律师集团(广州)事务所  
住所:广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼  
负责人:程渠  
电话:020-38799345  
传真:020-38799335  
经办律师:黄贞、周珊珊  
联系人:程渠  
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:卢伯卿  
联系人:洪悦明  
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  
广发天天利货币市场基金  
第五部分 基金的类型  
货币市场基金。  
第六部分 基金的投资目标  
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,分析和研判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。  
第七部分 基金的投资方向  
本基金的投资范围包括:  
1. 现金;  
2. 通知存款;  
3. 短期融资券;  
4. 剩余期限在397天以内(含397天)的债券;  
5. 1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;  
6. 期限在1年以内(含1年)的债券回购;  
7. 剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;  
8. 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”);  
9. 剩余期限在397天以内(含397天)中期票据、0、中国证监、会、中国人民银行的其他具有良好流动性的货币市场工具。  
如果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,将其纳入本基金的投资范围。其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。  
第八部分 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,分析和研判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,影响短期利率变动的因素更多,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、财政部等宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场运行的影响非常深远。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紧宽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特征。  
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。重点关注的宏观经济指标包括:国家经济管理部门政策、预期物价指数、相关市场资金供求关系等。  
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,构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般来说,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,尽可能的将大交易对手方的覆盖范围,通过对这些银行广泛、耐心而细致的询价,找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相当,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、持有高流动性券种、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量配置,以满足日常赎回的基金资产变现需求。  
第九部分 业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为人民币活期存款利率(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生效。  
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,经基金管理人和本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。  
第十部份 风险收益特征  
本基金属于货币市场基金,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 基金投资组合报告  
广发基金管理有限公司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。  
基金托管人中国银行根据本基金合同约定,于2015年8月26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、误导性陈述或重大遗漏。  
本投资组合报告所载数据截至2015年6月30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	235,160,551.19	52.83
	其中:债券	235,160,551.19	52.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	85,000,447.50	19.10
	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	63,582,367.51	14.29
4	其他资产	61,348,807.82	13.78
5	合计	445,092,174.02	100.00

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	33,861,663.07	8.24
2	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资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明  
本基金合同约定:“除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%”,本报告期内,本基金未发生超比例情况。

3、基金投资组合平均剩余期限  
3.1 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	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

本报告期内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,本基金未发生超比例情况。

3.2 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	33.73	8.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	10.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	4.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	93.41	8.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	20,014,536.74	4.87
	其中:政策性金融债	20,014,536.74	4.87
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	215,146,014.45	52.37
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	235,160,551.19	52.24

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	17次
报告期内偏离度的最高值	0.3796%
报告期内偏离度的最低值	0.0148%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1972%

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