

农银汇理7天理财债券型证券投资基金招募说明书(2015年第2号更新)摘要

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司

本基金的募集申请经中国证监会2012年12月5日证监许可[2012]1636号文核准。基金管理人根据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券监督管理委员会(以下简称“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或收益做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,投资者根据所持有份额享受基金的收益,同时也可能要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素变化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,由于基金资产持有人大量赎回或基金产生的流动性风险,基金管理人及基金财产实施过程中产生的基金管理风险,某一基金的特有风险等。本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。投资者有风险,投资者认购(申购)基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人已经对本招募说明书中与托管业务相关的更新信息进行了复核、审查,招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年8月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人
(一)公司概况
名称:农银汇理基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道501号
办公地址:上海市浦东新区世纪大道501号
法定代表人:刁双文
成立日期:2008年3月18日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:证监许可[2008]1307号
组织形式:有限责任公司
注册资本:人民币贰亿元整
存续期间:持续经营
联系人:崔爱东
联系电话:021-61096588

股东	出资额(元)	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中国建设银行股份有限公司	30,000,000	15%
合计	200,000,001	100%

(二)主要人员情况
1.董事会成员:
刁双文先生:董事长
1976年起从事金融行业,具有三十余年金融从业经验。1990年起历任中国农业银行山东省龙口市支行行长,山东省分行部门负责人及副行长,青岛分行行长,山东省分行行长。2010年起历任中国农业银行信贷管理部总经理、运营管理部总监、投资总监,现任中国农业银行合规总监。2012年8月起兼任农银汇理基金管理有限公司董事长。

Bernard Canyan先生:副董事长
经济学博士。1978年起历任法国农业信贷银行集团督察员,中央风险控制部主管,东方汇理银行和东方汇理投资管理有限公司风险控制部部门主管,东方汇理资产管理公司管理委员会成员。现任东方汇理资产管理公司副总监。

许金超先生:董事
高级经济师,经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作,历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长,中国农业银行山西分行党委副书记,中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长,中国农业银行采购管理部总经理,中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

Thierry Mequille先生:董事
工商管理硕士。1979年开始从事银行工作,在Credit Agricole Indosuez 工作15年并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司,任香港地区总经理。1999年起至今任东方汇理资产管理香港有限公司亚太区行政总裁。

曹尉志先生:董事
工商管理硕士,高级会计师。1986年开始在中国海洋石油公司工作,先后任总公司财务部、资金部总经理,中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起,任中国铝业公司副总经理,并先后兼任中国海外控股有限公司总裁、中国铝业国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。

华若鸣女士:董事
高级工商管理硕士,高级经济师。1989年起在中国农业银行工作,先后任中国农业银行总行国际业务部副经理、香港分行总经理,中国农业银行电子银行部副经理。现任中国农业银行总行国际业务市场部总经理兼基金交易中心总经理、外汇交易中心总经理。

王小卒先生:独立董事
经济学博士。曾任香港城市大学助理教授,世界银行顾问,联合国韩国、韩国首尔国立大学客座教授。现任复旦大学管理学院会计学金融系教授,兼任香港大学商学院联合教育管理学院客座教授。

傅晓斌先生:独立董事
经济学博士,高级经济师。1973年起,任江苏省盐城汽车运输公司教师,江苏省人民政府研究中心科员。1990年3月起任江苏财务咨询公司总经理。

徐信忠先生:独立董事
金融学博士,教授。曾任英国Bank of England货币政策局金融经济学家;英国兰卡斯特大学管理学院金融学教授;北京大学光华管理学院副院长、金融系教授。现任北京大学岭(大学)学院院长、金融系教授。

2.公司监事
Jean-Yves Glain先生:监事
硕士。1995年加入东方汇理资产管理公司,历任销售部负责人、市场部负责人、国际事务协调和销售部副负责人。现任东方汇理资产管理公司国际协调与支持部负责人。

欧小武先生:监事
1985年起在中国有色金属工业总公司,中国铜铅锌集团公司工作。2000年起历任中国铝业公司和中国铝业股份有限公司处长、财务部(审计部)主任和财务部总经理。2001年至2006年任中国铝业股份有限公司董事。现任中国铝业公司审计部主任,中国铝业股份有限公司审计部部长。

胡建忠先生:监事
工商管理硕士。2004年起进入基金行业,先后就职于长城基金管理有限公司、富国基金管理有限公司。2007年参与农银汇理基金管理有限公司筹建工作,2008年3月公司成立后任市场部总经理。

杨晓女士:监事
管理学学士。2008年加入农银汇理基金管理有限公司,现任综合管理部人力资源部经理。

3.公司高级管理人员
刁双文先生:董事长
1976年起从事金融行业,具有三十余年金融从业经验。1980年起历任中国农业银行山东省龙口市支行行长,山东省分行部门负责人及副行长,青岛分行行长,山东省分行行长。2010年起历任中国农业银行信贷管理部总经理、运营管理部总监、投资总监,现任中国农业银行合规总监。2012年8月起兼任农银汇理基金管理有限公司董事长。

许金超先生:总经理
高级经济师,经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作,历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长,中国农业银行山西分行党委副书记,中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长,中国农业银行采购管理部总经理,中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

卫卫东先生:副总经理
金融学硕士,金融理学硕士。1992年7月起任中国农业银行上海市浦东分行国际部副经理,办公室主任、行政助理,2002年7月起任中国农业银行上海市分行公司业务部副经理,2004年3月起任中国农业银行香港分行副经理,2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司副经理兼市场总监,2010年10月起任中国农业银行东方汇理筹备组组长,2012年12月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

崔爱东先生:督察长
高级工商管理硕士。1988年起先后在中国农业银行(中国城乡金融报)社、国际部、伦敦代表处、银行卡部工作。2004年11月起参加农银汇理基金管理有限公司筹备工作。2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书、监察稽核部总经理,2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

4.基金经理
史向东先生:理学硕士,15年证券和基金从业经历,具有基金从业资格,现任农银汇理基金管理有限公司投资管理部副经理。历任中国银河证券公司上海总部债券研究员,上海总部基金管理部债券研究员及基金经理,上海摩根基金管理公司固定收益部投资经理,农银汇理基金管理有限公司债券研究员及基金经理助理,现任固定收益部副经理,中国农业银行托管业务部基金经理,农银汇理申购收益债券基金基金经理,农银汇理7天理财债券型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型基金基金经理。

5.投资决策委员会成员
本基金采取集体投资决策制度。
投资决策委员会由下述委员组成:
投资决策委员会主任许金超先生,现任农银汇理基金管理有限公司总经理;
投资决策委员会成员傅晓斌女士,投资副经理兼兼任投资部总经理,农银汇理消费主题股票型证券投资基金基金经理,农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金经理;
投资决策委员会成员戚晟先生,研究部副经理;
投资决策委员会成员史向东女士,固定收益部副经理,农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理增利收益债券型基金基金经理,农银汇理7天理财债券型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型基金基金经理。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。
二、基金托管人
(一)基金托管人基本情况
中国建设银行成立于1906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。中国建设银行于2006年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码9630),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601398)。于2014年末,中国建设银行市值为2,079.6亿元,居全球上市银行第四位。

2014年末,本集团总资产67,441.30亿元,比上年增长8.99%。客户贷款和垫款总额94,745.23亿元,增长10.30%;存款总额128,986.76亿元,增长5.63%。营业收入5,704.70亿元,比上年增长12.16%,其中,利息净收入12,288.28亿元,同比增长12.89%;手续费及佣金净收入占营业收入比重为19.02%;成本收入比为28.85%。利润总额2,990.86亿元,比上年增长6.89%;净利润2,282.47亿元,增长6.10%。资本充足率14.87%,不良贷款率1.19%,拨备覆盖率222.33%。

客户基础进一步夯实,全年个人机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增11万户和68万户,个人有效客户新增1,188万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大,综合业务网点达到1,377万个,综合柜员占比达到80%,综合营销团队1.75万个,网点功能逐步向客户营销平台、体验展示和产品展示平台转变。深化网点柜面业务整合后,全行超过1,465万个营业网点30类柜面实时性业务产品实现总行集中处理,处理效率提高60%。总分之间、总分与子行之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得管理突破,协同综合性、多功能优势逐步显现。

业务经营实现全面突破,3,989.83亿元,承销额连续四年位居行业第一。以“共赢”为主品牌的养老金金融产品体系进一步丰富,养老金受托资产管理、账户管理规模分别新增188.32亿元和82.24亿元。投资托管业务规模增幅达306.6%,新增证券类基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户突破1万个,结算量达1,467.5亿元。信用卡累计发卡量6,593.7万,消费交易额16,580.81亿元,多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进,客户数量增长14.18%,金融资产增长18.21%。

2014年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的100余项重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第2;在英国《金融时报》全球500强排名第29位,新兴市场600强排名第3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司200强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位。此外,本集团还荣获国内外重要媒体评价的诸多重要奖项,覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和金融科技等多个领域。

中国建设银行总行设托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产处、理财信托托管处、养老金及OFI托管处、另类资产处、清算及核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海总部,共设员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,已具备完善的内控体系及内控工作程序。

(二)主要人员情况
赵蔚青,投资托管业务部副经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟,投资托管业务部副经理,曾就职于中国建设银行南通分行,中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部,公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军旺,投资托管业务部副经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部,个人银行业务部,行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务推广等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张力铮,投资托管业务部副经理,曾就职于中国建设银行总行运营管理部、信贷二部、信贷部、信贷管理部和信贷经营部,公司业务部,并在总行运营管理部和中国建设银行北京分行担任领导职务,长期从事信贷业务和运营管理部工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强资产托管业务内控控制,严格履行托管人的各项职责,切实保障资产持有人的合法权益

益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老金个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末,中国建设银行已托管14只证券投资基金。中国建设银行资产高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行于2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构
(一)基金分销机构
1.直销机构:
名称:农银汇理基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道501号农银大厦50层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道501号农银大厦50层
法定代表人:刁双文
联系人:沈颖
客户服务电话:4006895699,021-61096599
联系电话:021-61096610
网址:www.abcc-cu.com

2.代销机构:
(1)中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:刘士余
客服电话:96599
网址:www.abchina.com

(2)中国建设银行股份有限公司
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:王洪章
联系人:张静
客服电话:96533
网址:www.ccb.com

(3)中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-60833722
传真:010-60833739
客服电话:96568
网址:www.citics.com

(4)中国证券(浙江)有限责任公司
住所:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法人代表:袁振
联系人:李璐
电话:0671-89783737
传真:0671-85108383
客服电话:96548
网址:www.bigsun.com.cn

(5)中信证券(山东)有限责任公司
住所:山东省青岛市市南区东海西路222号1号楼2001
办公地址:(山东省青岛市市南区东海西路222号1号楼2001
法定代表人:杨宝林
联系人:吴昊超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客服电话:96548
网址:www.citicsec.com

(6)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际金融中心大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际金融中心大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:田薇
电话:010-66568430
传真:010-66568990
客服电话:400-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(7)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼3楼
法定代表人:其实
联系人:潘楠
电话:021-54509898
传真:021-64385308
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com

(8)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区中环路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区南118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张璐
电话:021-20613999
传真:021-68699616
客服电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

(9)杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号11楼202室
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:张皓
电话:021-60897840
传真:0571-26897013
客服电话:4000-776-123
网址:www.fund123.cn

(10)深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展大厦A座11、12单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展大厦A座25楼11、12单元
法定代表人:薛峰
联系人:董伟平
电话:0755-33227950
传真:0755-82087700
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn

(11)深圳市华融泰证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人:陈操
联系人:刘宝文
电话:010-5825326
传真:010-58253852
网址:www.hrtf.com

(12)和讯信息科技有限公司
住所: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:王荔
联系人:高利明
客户服务电话:4006895699
网址:www.hexun.com

(13)其他代销机构
其它代销机构名称及其官方网站公告。
(二)登记机构
农银汇理基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道501号农银大厦50层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道501号农银大厦50层
法定代表人:刁双文
电话:021-61096598
传真:021-61096566
联系人:高利明
客户服务电话:4006895699

(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:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
联系电话:(021)51012288
传真:(021)51010398
联系人:廖海

(四)审计机构会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所有限公司
住所:上海市延安西路222号外滩中心30楼
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法定代表人:卢煜
联系电话:021 61411888
传真:021 63300003
经办注册会计师:曹俊,吴晟志

四、基金名称
农银汇理7天理财债券型证券投资基金
五、基金类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
在严格控制风险和保持组合资产高流动性的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

七、投资范围
本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或存续期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,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)的央行票据,短期融资券,及法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接在二级市场上买入股票,权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。

若法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
八、投资策略
1.久期调整策略
债券组合久期根据反映利率风险的最重要指标,基金管理人将对未来短、中、长期收益率变动情况进行预期的基础上,对于组合内各种期限结构进行相应的调整。
当前期市场利率上升时,通过增加持有短期债券等方式降低组合久期,以降低组合整体风险;在预期市场利率下降时,通过增持长期债券等方式提高组合久期,以充分分享市场利率上升的收益。

随着短、中、长期利率变化的幅度不同,债券组合利率风险可能会出现非平行移动,由此造成变化,斜率变动等情况。管理人将通过对收益率曲线形态变动的预期,合理配置在短、中、长期券种上的资产配置比例,对于预期收益率下降的期限配置增加权重,而对于预期收益率上升的期限段的资产配置比例,充分利用利率变动带来的投资机会。
2.类属配置策略
由于受到不同债性的影响,金融债、企业债、可转债、短期融资券等不同类别的债券收益率变动在特征上表现出明显的差异,并呈现出不同的利率变化趋势。基金管理人将密切关注不同类别的债券收益率曲线的变化特征,分析各类券种的利率变化方向,并在此基础上,合理配置并密切跟踪不同类别债券在组合中的构成比例,增加预期收益率将上升的债券品种的投资比例,降低预期利率下降的券种的投资比例。对于符合套息策略的债券,本基金将仅买入回购自息不超过397天以内的债券,并在回购日内进行回售或卖出。

3.信用策略

本基金将充分借鉴外部的信用评级结果,并建立内部信用评级体系,根据对债券发行人及债券资信状况的分析,给出主体和标的债券打分,给出各目标信用债券基于综合得分的信用评级等级,并建立信用债券库。基金管理人将密切跟踪发行人基本面的变化情况,通过卖方报告及实地调研等方式,对于发行人的行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险进行综合评价,从而得出信用违约可能性和理论信用利差水平,并以此为基础进行债券定价。在发行人信用状况发生变化后,基金管理人将采用变化后债券信用评级所对应的信用利差曲线对该信用债进行合理定价。

4.息差放大策略

该策略是利用债券回购收益率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式即利用买入债券进行正回购,再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种,如此循环至回购期结束卖出债券偿还所融入资金。在进行回购放大操作时,必须考虑到始终保持债券收益率与回购融资利率的相互关系,只有在回购利率低于债券收益率时该策略才能够有效执行。

若未来有以固定收益品种为基础资产的衍生品推出,则基金管理人将在届时法律法规和中国证监会规定的框架内,以风险管理为目标,在充分考虑衍生品风险收益及交易特征的基础上,严格执行控制流程,审慎参与衍生品交易。

9.业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:人民币7天通知存款利率(税后)
人民币7天通知存款是一种不约定存期、一次性存入、可多次支取,支取时需提前7天通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款。该通知存款具有流动性强、利率高于活期存款的特征,与本基金基金的特征类似。

如果今后法律法规发生变化,或市场出现更合适、更权威的比较基准,并且更接近本基金风格时,经基金托管人同意,本基金管理人可在履行适当程序之后,可选用新的比较基准,并将及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金,但低于混合型证券投资基金和股票型基金。

十一、投资组合报告

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2015年9月1日复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容。
本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	963,333,927.96	33.94
	其中:债券	963,333,927.96	33.94
2	买入金融资产	254,022,221.04	9.06
	其中:买入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	1,270,024,680.19	43.70
4	其他资产	63,982,464.04	2.31
5	合计	2,561,363,288.83	100.00

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.48
	其中:中央国债登记结算有限责任公司	0.00
2	报告期内债券回购融资余额	31,359,794.32
	其中:中央国债登记结算有限责任公司	-

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:
本报告期内本基金债券正回购资金余额占基金资产净值的比例未超过资产净值的20%。

序号	项目	天数
1	报告期内债券回购融资余额	126
	其中:中央国债登记结算有限责任公司	132
2	报告期内债券回购融资余额	106
	其中:中央国债登记结算有限责任公司	-

序号	发生日期	平均剩余期限	期初	期末
1	2015年4月1日	132	132	2个工作日

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在下一个交易日不得超过127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	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	16.08	1.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天至<60天	6.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天至<90天	26.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天至<180天	26.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	180天至<397天(含)	24.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
合计		98.77	1.26

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	地方政府债	-	-
3	金融债券	150,180,829.39	5.96
	其中:政策性金融债	150,180,829.39	5.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	713,147,098.57	28.32
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	863,333,927.96	34.28
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	146303	14国债03	300,000	29,323,388.52	1.20
2	140443	14农债43	300,000	29,997,030.58	1.19
3	150307	15国进07	200,000	20,156,444.99	0.80
4	04181016	15川水债C901	200,000	20,109,374.51	0.80
5	146223	14国债23	200,000	20,039,713.11	0.80
6	04184803	15高新南债C901	200,000	20,030,027.47	0.79
7	04183118	14国债31	200,000	20,003,566.49	0.79
8	01159089	15国债09	200,000	20,000,470.06	0.79
9	041851024	15国债57	200,000	20,000,136.63	0.79
10	041851040	14国债51	200,000	19,999,720.00	0.79

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	146303	14			