

上接A55版

联系电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客服电话:400-666-1618,95573
网址:www.i618.com.cn
75) 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼
办公地址:上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼
法定代表人:龚德胜
联系人:张瑾
客户服务电话:(021)962518,4008918918(全国热线)
公司网址:www.962518.com
76) 申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区区长乐路989号45层(邮编:200031)

法定代表人:李梅
电话:021-33389888
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
国际互联网网址:www.swhysc.com
联系人:黄莹
77) 联华证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人:卢长才
联系人:袁媛
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网站: www.csco.com.cn
客服热线:0755-83199511
78) 天源证券股份有限公司
注册地址:西安市城中区西大街11号
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
电 话:0755-33331188
传 真:0755-33329815
79) 万联证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋

18.19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋
18.19层
法定代表人:张建军
咨询电话:400-8888-133
接收传真:020-22373718-1013
联系人:王鑫
联系电话:020-38296651
邮箱:wangxin@wlzq.com.cn
80) 五矿证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公
47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办
公室48层
法定代表人:张永衡
电 话:0755-82545555
公司网站:http://www.wkzq.com.cn/wkzq/web/index.aspx

81) 湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务
中心A栋11层
办公地点:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务
中心A栋11层
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:赵小明021-68634510-8620
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com.cn
82) 新时代证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层

1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层
1501
法定代表人:刘汝军
开放式基金咨询电话:400-698-9898
开放式基金业务传真:010-83561094
联系人:孙恒
联系电话:010-83561149
网址:www.xsxdz.com
83) 信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
84) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
办公地址:浦东新区民生路1199弄正大五道口广场1号楼

20层
法定代表人:兰荣
客服电话:95562
业务联系电话:0591-38162212
公司网址:http://www.xyzzq.com.cn/xyzq/index.html
85) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
开放式基金咨询电话:4008-888-888
开放式基金业务传真:010-66568990
联系人:田薇
联系电话:010-66568430
网址:www.chinastock.com.cn
86) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:95565,4008881111
公司网址:www.newone.com.cn
87) 中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金
融大厦A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金
融大厦A座41楼
法定代表人:王宜四
电话:0791-86768681
联系人:戴蕾
客户服务电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com
88) 中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及

28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及
28层
法定代表人:金立群
电 话:010-65051166
传 真:010-85679535
公司网址:http://www.cicc.com.cn
89) 中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光复道23甲
办公地址:沈阳市和平区南五马路121号万丽城晶座4楼
中天证券经纪事业部
法定代表人:马功勋
联系人:袁劲松
联系电话:024-23280842
客服电话:4006180315
公司网站:www.stockten.com
联系人:袁劲松
90) 中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务
中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、
16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋
第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invscn
客服电话:400-800-8008,95532

91) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区门内大街188号
法定代表人:姓名:王常青
基金业务对外联系人:权旭
联系电话:400-8888-108
联系传真:010-65182261
公司网站:www.csc.com.cn
客服电话:400-8888-108
92) 中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦
主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦
主楼19、20层
法人代表:沈强
联系人:王需需
联系电话:95548
公司网站:www.bigsun.com.cn
93) 中信证券(山东)有限公司
注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广
场1号楼20层(266061)
办公地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广
场1号楼20层(266061)
法定代表人:杨宝林

基金业务联系人:吴志超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务热线:95548
公司网址:www.citicssd.com
94) 中信证券股份有限公司
注册地址: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
传真:010-60833739
联系人:顾波
公司网址:www.cscecitic.com
95) 中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:李丹
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:021-68604866
公司网址:www.bocichina.com
96) 中原证券股份有限公司
公司名称:中原证券股份有限公司
地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
客服电话:0371-967218,4008139666
联系人:程月艳 范春池
联系电话:0371-6909882
联系传真:0371-65585899
网站:www.ccnew.com
97) 天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮
编:100032
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505 邮
编:100088
法定代表人:林义相
联系人:尹玲
联系电话:010-66045152
客服电话:010-66045678
传真:010-66045618
天相投顾网站: http://www.txsec.com
98) 华泰金富证券投资咨询有限公司
注册地址:上海市金浜路投资咨询有限公司
注册地址:无锡市滨湖区锦溪路99号
办公地址:无锡市滨湖区锦溪路99号
法定代表人:费晓燕
电 话:0510-82758877
传 真:0510-85558585
99) 深圳市新华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
公司地址: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:马令海
订购热线:4009-945-899
客服中心:0755-88399099
传真号码:0755-88394677
新兰德网站:http://www.new-rand.cn/
100) 和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客服电话:4008-773-772
联系人:周佚
电话:021-20835789
传真:021-20835885
网站:www.5ifund.com
101) 厦门市鑫鼎盛证券投资咨询有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人:林松
联系人:高雪
电话:0592-3122719
传真:0592-8060771
客户服务电话:400-6980-777
网站:www.dkhs.com
102) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市金山区漕泾镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8
楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38600735
传真:021-38509777
103) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦
25楼J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦
25楼J单元
法定代表人:薛峰
联系电话:0755-33227950
客服电话:4006-788-887
传真:0755-82080798
联系人:董彩平
网站:www.zlfund.com 及 www.jmmw.com

104) 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10楼
注册资本:人民币伍仟万元
法定代表人:其实
电 话:021-54509988
传 真:021-64385308
105) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区南汇1118号鄂尔多斯国际大厦
903-906室
法定代表人:杨文斌
电 话:021-58870011
传 真:021-68596919
公司网站:http://www.howbuy.com/
106) 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
电话:021-60897840
传真:0571-26689533
客服电话:4000-766-123
网站:http://www.fund123.cn/
107) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道655号裕景国际B座

20层
法定代表人:张欣伟
联系人:单内桢
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.erichfund.com
108) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2
楼
邮 编:310012
联系人:胡璇
联系电话:0571-88911818
传 真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com
109) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门内华严北里2号民建大厦
6层
法定代表人:闫振斌
电 话:010-62020088
传 真:010-62020088-8002
110) 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:上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
法定代表人:盛大
电话:021-50583533-3006
传真:021-50583633
客服电话:400-005-6355
网站:www.leadfund.com.cn
111) 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16号1幢11层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路瑶
电话:010-65807865
传真:010-65807868
客服电话:95162 4008888160
网站:www.cifcofund.com
112) 北京创金启富投资管理有限公司
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:梁霄
电话:010-66154828
传真:010-88067526客服电话:010-88067525
网站:www.5irich.com
113) 泛华普益基金销售有限公司
注册地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海峰
电话:028-82000996
传真:028-82000996-805
客服电话:4008-588-588
网站:http://www.pyfund.cn/
114) 万利财富(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号院5号楼3201内
3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

3201单元
法定代表人:王斐
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客服电话:400-808-0069
网站:www.wy-fund.com
115) 北京增利基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦
1208-1209室
法定代表人:罗细安
电话:010-67000988
传真:010-67000988-6000
联系人:孙晋峰
网站:www.zvcv.com.cn
客户服务电话:400-001-8811
116) 上海汇付金融服务有限公司
名 称:上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市浦东新区南汇100号金外滩国际广场19楼
邮政编码:200010
注册资本:2000万人民币
法定代表人:张磊
电 话:021-33323998
传 真:021-33323993
117) 中信期货有限公司
客服电话:400-990-8826
网站:www.citicfc.com
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) 注册登记机构
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市浦东新区法华路268号6幢538室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932888
传真:(021)28932998
联系人:韩从慧
(三) 律师事务所和经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:吕红、黎明
(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)
首席合伙人:吴建亚
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安
永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸
城安永大楼16层
邮政编码:100738
公司电话:(010)58153000
公司传真:(010)85188298
签字会计师:陶育华、汤敏
业务联系人:汤敏

四、基金名称
本基金名称:汇添富理财30天债券型证券投资基金。
五、基金的类型
本基金为债券型证券投资基金。
六、基金的投资目标
本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,努力
追求绝对收益,为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。
七、基金的投资方向
本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知
存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大部分存单、剩余期
限(或回售期限)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)的中央银行票据、短期融资券,及法律法
规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。
如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
本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均
剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、尽量降低基金
净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
九、基金的投资限制
1. 利率策略
本基金采取“自上而下”的债券分析方法,确定债券组合,
并管理组合风险。
首先通过全面分析宏观经济运行情况和金融市场资金供
求,判断宏观经济与流动性状况及其变化趋势,进而对财政政
策、货币政策等宏观经济政策取向进行研判,从而判断金融市
场利率水平变动趋势。在此基础上,结合期限利差与凸度的综
合分析,确定投资组合的久期配置,制定出具体的投资策略。
具体而言,本基金将首先采用“自上而下”的研究方法,综
合研究主要经济变量指标,分析宏观经济情况,建立经济前
景的情境模拟,进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取
向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势,对
影响宏观面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模
拟。

在宏观分析与流动性分析的基础上,结合历史与经验数
据,确定当前资金面的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素,
得到当前宏观与流动性条件下均衡收益率曲线。区分当
前利率期限收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史
分位,然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,判
断收益率曲线参数变化的程度和概率,确定组合的平均剩余期
限,并据此动态调整投资组合。
2. 信用策略
本基金依靠内部信用评级系统跟踪研究发债主体的经营
状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估,以此作为个券
选择的基本依据。为了准确评价发债主体的信用风险,我们设
计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体
系遵循从“行业风险”-“公司风险”(公司背景+公司行业
地位+企业盈利模式+公司治理结构和信息披露状况+企业
财务状况)-“债项支持”(外部流动性支持能力+债券担保增
信)-“得到评分”的评级过程。其中,定量分析主要是指对企
业财务数据的定量分析,定量分析主要包括四个方面:盈利能
力分析、偿债能力分析、现金流量获取能力分析、营运能力分析。
定性分析包括所有非定量信息的分析和研究,它是对定量分析
的重要补充,能够有效提高定量分析的准确性。
本基金内部的信用评级体系定位为周期评级,侧重于评级的
准确性。因此,通过全面的信用分析,我们能够积极主动的挖
掘到风险收益匹配,甚至存在超额收益的投资品种,为信用评
价的及时交易提供参考。本基金还会对宏观经济、行业、公司自
身信用状况的变化和趋势进行跟踪,并快速做出反应,及时有
效地抓住(信用利差变化带来的)市场交易机会。

除了跟踪债券自身的信用变化以外,本基金还会定期研究
各评级、各期限信用利差的变化趋势,分析它们相对投资价值
,确定各类债券的投资比例和期限选择。
3. 个券选择策略
本基金认为普通债券的估值,主要基于收益率曲线的拟
合。在正确拟合收益率曲线的基础上,及时发现偏离市场收益
率的债券,并找出因投资者偏好、供求、流动性、信用利差等导
致债券价格偏离的原因;同时,基于收益率曲线判断出定价偏
高或低估的期限段,从而指导相对价值投资,选择出估值较低
的债券品种。
对于含回售条款的投资品种,本基金将仅买入距回售日不超过
397天以内的债券,并在回售前进行回售或卖出。
4. 其他衍生品工具投资策略
本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,一旦有新的
产品推出市场,在履行适当程序后,将在届时相应法律法规的
框架内,制订符合本基金投资目标的投资策略,同时结合对衍
生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提
下,谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规利用其他衍
生金融工具进行套利、避险交易,控制基金组合风险,并通过
灵活运用趋势投资策略获取收益。
(一) 投资决策依据和投资程序
1. 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) 国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响;
(3) 企业信用评级;
(4) 国家货币政策及债券市场政策;
(5) 商业银行的信贷状况;
2. 投资决策机制
本基金实行投资决策团队制,强调团队合作,充分发挥集
体智慧。本基金管理人将投资和研究人员整合,设立了投资研
究部、策略分析师、固定收益分析师、数量分析师和基金经
理,充分发挥主观能动性,渗透到投资研究的关键环节,群策群
力,为基金投资决策团队人谋取中长期稳定的较高投资回报。
3. 投资决策程序
本基金具体的投资决策流程与流程为:
(1) 宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策
等判断市场利率的走向,提交策略报告。
(2) 债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场
供求、收益率曲线期限结构分析报告。
(3) 信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及
信用评级的调整。
(4) 数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。
(5) 在分析研究报告的基础上,基金经理进行月度投资计
划并提交投资决策委员会审议。
(6) 投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。
(7) 如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑
选合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。
(8) 集中交易室执行交易指令。
(三) 投资限制
1. 本基金不得投资于以下金融工具:
(1) 股票;
(2) 可转换债券;
(3) 剩余期限(或回售期限)超过397天的债券;
(4) 信用等级在A-级以下的企业债券;
(5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,但市场
条件发生变化后另有规定的,从其规定;
(6) 非标准化债权类资产及资产支持证券或交易所交易的
资产支持证券;
(7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。
法律法规或监管部门取消上述限制后,本基金不受上述规

定的限制。
2. 组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1) 本基金投资债券的平均剩余期限在每个交易日均不
得超过150天;
(2) 投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券
的比例,合计不得超过基金资产净值的10%;
(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发
行的证券,不超过该证券的10%;
(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资
金余额不得超过基金资产净值的40%;
(5) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不
得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一
商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;
(6) 本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期
超过397天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金
资产净值的20%;
(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券
的比例,不得超过基金资产净值的10%;本基金持有的全部资
产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金持
有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该
资产支持证券规模的10%;本基金管理人管理的全部基金投
资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类
资产支持证券合计规模的10%;本基金应投资于信用级别评
级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券。基金持有资产支
持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评
级发布之日起3个月内予以全部卖出;
(8) 本基金投资的短期融资券的信用评级,应不低于以下
标准:
1) 国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短
期信用级别;
2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券,其发
行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一:
(1) 国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的
长期信用级别;
(2) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别
的信用级别(例如,若中国主权评级为A-级,则低于中国主权
评级一个级别的为BBB+级)。
(3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评
级的,以国内信用级别为准。
4) 本基金持有短期融资券期间,如果其信用等级下降、不
再符合投资标准,应在评级报告发布之日起20个交易日予以
全部减持。
(9) 中国证监会规定的其它比例限制。
因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分
置改革中支付对价等基金管理人以外的因素致使基金投资比例
不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易
日内进行调整。
基金管理人应当自基金合同生效之日起60个月内使基金
的投资组合比例符合基金合同的有关规定。基金托管人对基金
的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基
金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。
3. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下
列投资或者活动:
(1) 承销证券;
(2) 向他人贷款或者提供担保;
(3) 从事承担无限责任的投资;
(4) 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金
管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股
东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司
发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券
交易活动;
(8) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其
他活动。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。
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。
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,或者是市场上出现更加适合
用于本基金业绩比较基准时,经与基金托管人协商一致,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。
十、基金的风险收益特征
本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于
股票型基金、混合型基金,高于货币市场型证券投资基金。
十一、基金的销售渠道
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,并对其内容的真实性、准确
性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同
规定,于2015年10月23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。
本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。
十二、基金的投资组合报告
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	365,247,027.91	56.30
其中:债券	365,247,027.91	56.30	
2	买入返售金融资产	-	-
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	236,497,436.28	43.46
4	其他资产	7,666,500.77	1.16
5	合计	609,400,965.96	100.00

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券投资融资情况	3.11
其中:买断式回购融资	0.00	
2	报告期末买入返售金融资产融资情况	0.00
其中:买断式回购融资	0.00	

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例
为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
注:本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市
场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”,
本报告期内,本基金未发生超标情况。
1.3 基金投资组合平均剩余期限期限
1.3.1 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	139
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	139
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	139

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
注: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150天”,本报告期内,本基金未发
生超标情况。
1.3.2 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	报告期内基金资产净值中 的占比(%)	报告期内基金资产净值中 的占比(%)
1	30天以内	24.72	-
其中:剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-	-
2	30天-60天	5.32	-
其中:剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-	-
3	60天-90天	9.74	-
其中:剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-	-
4	90天-180天	36.38	-
其中:剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-	-
5	180天-397天(含)	27.61	-
其中:剩余存续期超过397 天的浮动利率债	-	-	-
合计	365,247,027.91	56.54	-
报告期内投资组合平均剩余期限的浮 动利率债券	365,247,027.91	4.42	-

1.6 “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%-0.5%间的次数	40
报告期内偏离度的最高值	0.2627%
报告期内偏离度的最低值	0.0968%
报告期内偏离度绝对值在0.5%以上(不含0.5%)的次数	0.0000%

1.7 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	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	120227	12国债27	300,000	29,038,530.89
2	041554020	15民利投债 CPO01	200,000	20,366,941.01
3	041550006	15平遥 CPO01	200,000	20,397,530.91
4	041550828	15博康城建 CPO01	200,000	20,114,262.28
5	041554016	15博康城建 CPO01	200,000	20,113,161.06
6	041552021	15博康城建 CPO01	200,000	20,046,803.82
7	041541060	14大新华 CPO01	200,000	20,025,665.54
8	111513062	15博康城建 CPO02	100,000	19,064,262.06
9	041550817	15博康城建 CPO02	100,000	19,089,460.29
10	041550816	15博康城建 CPO02	100,000	19,089,049.77

1.8 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	债券余额(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	120227	12国债27	300,000	29,038,530.89
2	041554020	15民利投债 CPO01	200,000	20,366,941.01
3	041550006	15平遥 CPO01	200,000	20,397,530.91
4	041550828	15博康城建 CPO01	200,000	20,114,262.28
5	041554016	15博康城建 CPO01	200,000	20,113,