

# 北信瑞丰基金管理有限公司北信瑞丰现金添利货币市场基金招募说明书(更新)摘要

**基金管理人:**北信瑞丰基金管理有限公司  
**基金托管人:**华夏银行股份有限公司  
二〇一六年二月

## 重要提示

(一) 本次基金募集的准予注册文件名称为:《关于核准北信瑞丰现金添利货币市场基金的募集的批复》(证监许可〔2014〕1375号),注册日期为:2014年12月17日。

(二) 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。

(三) 基金有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,须承担基金投资出现的各类风险,包括:市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、操作及技术风险、合规性风险和其他风险等。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

(五) 本基金为货币市场基金,投资者购买本货币市场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,基金管理人保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

(六) 基金不同银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的

《招募说明书》及《基金合同》。

(七) 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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日为2016年12月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人华夏银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

## 一、基金管理人

一、基金管理人概况  
名称:北信瑞丰基金管理有限公司  
住所:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村736号  
办公地址:北京市海淀区首体南路9号主语国际大厦四号楼3层  
法定代表人:周瑞明  
设立日期:2014年3月17日批准设立机关:中国证监会  
批准设立文号:证监许可[2014]265号组织形式:有限责任公司注册资本:人民币1.7亿元存续期限:持续经营  
联系人:吕仕静  
联系电话:010-68619312  
股权结构:北信瑞丰基金管理有限公司是经中国证监会证监许可[2014]265

号文批准,由北京国际信托有限公司与莱州瑞海投资有限公司公司共同发起设立,注册资本达1.7亿元人民币。目前股权结构:北京国际信托有限公司60%、莱州瑞海投资有限公司40%。

## 二、主要人员情况

1、董事会成员  
周瑞明先生,董事长,中共党员,毕业于中国社会科学院工经所,获博士学位。历任原河北省师范学院政教系助教,中国人民大学金融管理科干部,原国务院证券委办公室处长,中国证监会上市公司部监管二处处长,中国证监会信息统计部副主任,中国证监会党委办公室副主任、宣传部部长、系统团委书记,现任北京国际信托有限公司副总经理、北信瑞丰基金管理有限公司董事长。

吴京林先生,董事,中共党员,高级会计师,毕业于美国德大阿灵顿分校,获硕士学位。历任北京审计局职员,现任北京国际信托有限公司总会计师,北京国投汇成投资管理有限公司董事长、富晋阳光投资公司董事长。

田旭芳女士,董事,中共党员,经济师,毕业于清华大学经济管理学院,获硕士学位。历任中国技术进出口总公司金融部项目经理,现任北京国际信托有限公司证券业务部总经理。

朱彦生先生,董事,中共党员,助理会计师,毕业于中国人民大学投资经济系基本建设经济专业,获学士学位。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工、海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管,海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理,北京国际信托投资公司上海国际路证券营业部总经理、国都证券有限责任公司上海湖北路证券营业部总经理、国都证券有限责任公司上海长阳路证券营业部总经理,中欧基金管理有限公司督察长、副总经理,现任北信瑞丰基金管理有限公司总经理。

王薇女士,董事,中共党员,会计师,毕业于首都经济贸易大学会计系,获学士学位。历任北京万全会计师事务所项目经理、信永中和会计师事务所高级审计师、北京金象大药房医药连锁有限责任公司内审专员,现任北京正润创业投资有限公司财务总监。

赵鹏先生,董事,中共党员,中央财经大学经济学专业硕士。现任聚益科技投资有限公司总裁助理、运营总监。曾任北京正润创业投资有限公司项目经理。

李万生先生,独立董事,中共党员,毕业于哈佛大学法学院,获硕士学位。历任宁夏电视台干部、北京大学法学系讲师,现任北京天元律师事务所律师合伙人。

岳彦芳女士,独立董事,硕士,51岁,现任中央财经大学会计学院副教授,硕士研究生导师。  
 张青先生,独立董事,中共党员,教授,毕业于中国矿业大学(北京)经济管理学院,获博士学位。历任中国矿业大学管理学院副主任,现任复旦大学管理学院教授。

2、监事会成员  
 杨海坤先生,监事会主席,经济学硕士。历任山东省农业银行业务人员,山东证券登记公司业务经理,山东证券公司投行部经理,上海证证投资公司副总经理,卡特斯投资公司部门负责人、副总经理、总经理,现任正润创业投资有限公司财务总监、北信瑞丰基金管理有限公司监事会主席。

赵顺先生,监事,法学硕士。历任河北定州新华中学教师、河北林平律师事务所律师助理、北京正润创业投资有限公司投行部经理助理,现任北信瑞丰基金管理有限公司稽核检查部副经理。  
 崔丽伟女士,监事,大专学历。历任航海直真柜台售票主管、河北开元集团北京万通汽车贸易有限公司会计,现任北信瑞丰基金管理有限公司综合管理部财务。

3、公司高级管理人员  
 周瑞明先生,董事长,中共党员,毕业于中国社会科学院工经所,获博士学位。

历任原河北省师范学院政教系助教,中国人民大学金融管理科干部,原国务院证券委办公室处长,中国证监会上市公司部监管二处处长,中国证监会信息统计部副主任,中国证监会党委办公室副主任、宣传部部长、系统团委书记,现任北京国际信托有限公司副总经理、北信瑞丰基金管理有限公司董事长。

朱彦生先生,总经理,中共党员,助理会计师,毕业于中国人民大学投资经济系基本建设经济专业,获学士学位。历任北京国际信托投资公司计划财务部员工、海南赛格国际信托投资公司资金计划部主管,海南华银国际信托投资公司北京证券营业部总经理,北京国际信托投资公司上海国际路证券营业部总经理,国都证券有限责任公司上海湖北路证券营业部总经理,国都证券有限责任公司上海长阳路证券营业部总经理,中欧基金管理有限公司督察长、副总经理,现任北信瑞丰基金管理有限公司总经理。

高峰先生,副总经理,中共党员,毕业于北京大学光华管理学院国民经管理专业,获硕士学位,拥有律师资格证书。曾为全国人大财经委员会《破产法》起草小组成员,历任中国对外经济贸易信托投资公司计划财务部财务科经理和公司发展战略小组成员,中化总公司财务部财务综合部经理、宝盈基金管理公司筹备组成员、研究发展部高级策略分析师、研究发展部副总经理,中国对外经济贸易信托有限公司资产管理部副总经理、证券业务部总经理,资产管理部执行总经理并兼任宝盈基金管理有限公司董事,宝盈基金管理有限公司总经理助理兼任公司董事会主席,现任北信瑞丰基金管理有限公司副总经理。

张洪水先生,督察长,无党派人士,毕业于中国科学院研究生院管理科学与

工程专业,获博士学位。历任中央财政金融学院(现中央财政大学)经济信息管理系助教,中国长城计算机集团公司应用开发部、发展计划部职员,中国证监会监督管理委员会机构监管部主任科员,副处长,中国证券业协会资产管理部、场外市场委、发展战略委主任,长安基金管理有限公司督察长,现任北信瑞丰基金管理有限公司督察长。

李鑫先生,副总经理,无党派人士,毕业于对外经贸大学金融学专业硕士研究生。历任南财证券营业部总经理、泰达荷银基金管理有限公司北方区总经理、渠道部总经理、汇添富基金管理有限公司专户部总监、机构部总监、上银基金管理有限公司市场总监,北信瑞丰基金管理有限公司总经理助理,现任北信瑞丰基金管理有限公司副总经理。

# 信息披露

# Disclosure

联系人:孙睿  
 电话:(021)31358666  
 传真:(021)31358600  
 经办律师:吕虹、孙睿  
 四、审计基金财产的会计师事务所  
 名称:中喜会计师事务所(特殊普通合伙)  
 住所:北京东城区崇文门外大街11号新成文化大厦A座11层  
 办公地址:北京东城区崇文门外大街11号新成文化大厦A座11层  
 法定代表人:张增刚  
 联系人:王会松  
 联系电话:(010)67091210  
 传真:(010)6708417  
 经办注册会计师:王会松、吴兴华

四、基金的名称和类型  
 本基金名称:北信瑞丰现金添利货币市场基金  
 基金类型:契约性开放式

## 五、基金的投资

一、投资目标  
 在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。

## 二、投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,超短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款,大额存单,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,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的,在不改变本基金投资目标、不改变本基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场工具的投资,不需召开基金份额持有人大会。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

## 三、投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济发展态势、金融监管政策、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素的分析,形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上,本基金将根据不同类别资产的收益率水平(不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性),结合各类资产的流动性特征(日均成交量、交易方式、市场深度)和风险特征(信用等级、波动性),决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。

### 2、债券筛选策略

本基金将优先考虑安全性因素,优先选择股票、短期国债等高风险等级的债券品种进行投资以规避风险。在基金投资中对个券进行选择时,首先本基金将针对各券种的信用等级、剩余期限和流动性进行初步筛选;第二步,本基金将针对其投资价值,进行再次筛选。这一步主要针对各券种的收益率与剩余期限的结构合理性进行选择;最后,在第二步筛选的基础上,再评估各券种的到期收益率波动性与可投资量(流通量、日均成交量与冲击成本估算),从而综合决定具体各券种的投资比例。

### 3、现金管理策略

作为现金管理工具,本基金应具有较高的流动性要求。本基金将紧密关注申购/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,建立健全流动性监控管理机制,实现对基金资产流动性的实时管理。具体操作中,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,将回购融资的到期日进行均衡等量配置等手段,从而争取在保持充分流动性的基础上取得较高收益。

4、资产支持证券投资策略  
 当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主(包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产),仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和信用评级后择优投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

### 5、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许本类基金投资于其他衍生金融工具,基金管

理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资要以对提高组合整体收益为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险、谨慎投资。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,在履行相应程序后,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

## 四、基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

### 1、投资决策依据

(1)有关法律法规和基金合同的有关规定。  
 (2)经济运行态势和证券市场走势。  
 (3)投资对象的风险收益配比。

### 2、投资决策程序

(1)投资决策支持:研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究方案,向投资决策委员会提出宏观经济分析方案和投资策略方案等决策支持。

(2)法律依据的制定:投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定的前提下,根据研究人员和基金经理的有关方案,决定基金投资的主要原则,对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

(3)研究支持:研究人员根据投资决策委员会的要求,为基金经理提供各类分析方案和投资建议;也可根据基金经理的决议进行有关的研究。

(4)制定投资策略:基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则,根据研究人员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。

(5)风险控制与评估:风险管理委员会定期召开会议,听取投资研究部、基金经理、风险控制人员对基金投资组合进行的风险评估,并提出风险控制建议。

(6)组合的调整:基金经理有权根据环境的变化和实际的需要,在其权限范围内对组合进行调整,超出其权限的调整,需报投资决策委员会审批。

## 五、投资限制

1、本基金不得投资于以下金融工具:

- 股票。
- 可转换债券。
- 剩余期限超过397天的债券。
- 信用等级在AA+级以下的企业债券。
- 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。
- 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券。
- 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、组合限制  
 基金的投资组合应遵循以下限制:

- 本基金投资债券的平均剩余期限不超过120天。
- 本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%。
- 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%。
- 本基金管理人管理的全部基金持有同一公司发行的证券,不超过该证券的10%。
- 除发生巨额赎回的情形外,货币市场基金的投资组合中,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%。因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应当在5个工作日内进行调整。
- 存放在具有基金托管资格的同—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—商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%。
- 本基金投资于定期存款(不包括有存款期限,但根据协议可以提前支取且没有利息损失的银行存款)的比例不得超过基金资产净值的30%。
- 本基金持有的同一剩余期限超过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%。
- 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,不得超过该基金资产净值的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评级不低于AA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,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

- 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过397天。
- 本基金总资产不得超过其净资产的140%。
- 法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

除上述第(4)、(8)条外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

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:

- 承销证券;
- 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- 从事承担无限责任的投资;
- 向其基金管理人、基金托管人出资;
- 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;

(6)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。基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

4、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资策略、组合限制、投资禁止等作出强制性调整的,本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行;如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资策略、组合限制、禁止行为等,且该等调整或修改属于非强制性,则本基金管理人应与基金托管协商一致后,可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行,而无需基金份额

持有人大会审议决定,但基金管理人应在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前,应向投资者履行信息披露义务并向监管机构报告或备案。

## 六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率。

活期存款是具备最高流动性的存款,本基金期望通过科学严谨的管理,使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益,因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人的合法权益的原则,根据实际情况与业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前2日在中国证监会指定媒介上刊登公告,无需召开基金份额持有人大会。

## 七、风险收益特征

本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

## 八、基金的融资、融券

若法律法规或监管机构允许,本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 九、投资组合平均剩余期限的计算

1、平均剩余期限(天)的计算公式如下:

*注:本基金投资组合平均剩余期限的计算,采用天数精确到小数点后两位(四舍五入)的方法,即:1/360(一年按360天计算)。*

其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金),一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,剩余期限在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)的逆回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,买断式回购产生的待回购债券,中国证监会及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。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)正回购,买断式回购产生的待返售债券等。采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价;贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

## 2、各类资产和负债剩余期限的确定

(1)银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为天;证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期的实际剩余天数计算。  
 (2)一年以内(含一年)银行定期存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期的实际剩余天数计算;银行通知存款的剩余期限以存款协议中约定的通知期计算。

(3)组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外:  
 允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算;允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售日的实际剩余天数计算。

(4)回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期的实际剩余天数计算。  
 (5)中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。  
 (6)买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限。

(8)法律法规、中国证监会另有规定的,从其规定。十、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益;2、有利于基金财产的安全与增值;3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系第三人牟取任何不当利益。

## 十、基金的投资报告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定,编制季度报告和半年度报告,并在基金定期报告中披露报告期内基金资产净值、基金份额净值、基金资产净值增长率、基金份额持有人户数、基金份额持有人数量、基金资产净值变动及其主要原因等相关信息。基金管理人将在基金年度报告中,对基金的投资组合报告、报告期内基金资产净值增长率与业绩比较基准之间的差异分析、基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序、投资限制、投资组合报告等有关基金投资的重要信息进行详细披露。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

本投资组合报告期内所披露数据截至2015年12月31日,本报告所列财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	119,872,062.20	68.64
2	资产支持证券	119,872,062.20	68.64
3	买入返售金融资产	21,000,211.00	12.01
4	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和拆出资金项合计	32,872,002.24	18.65
6	其他资产	1,489,751.62	0.81
6	合计	174,855,037.86	100.00

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内投资合计平均剩余期限	0.10	
2	其中:买断式回购融资	1.16	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券持有余额占基金总资产	119,872,062.20	68.64
2	其中:买断式回购融资	-	-

本基金本报告期末无债券正回购。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的30%的说明  
 本报告期内本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
报告期内投资组合平均剩余期限	0.16
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	192
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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120天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

序号	平均剩余期限	报告期内本基金资产净值中该比例(%)	报告期内投资组合资产净值的比例(%)
1	30天以内	36.40	-
2	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	30天至60天	28.63	-
4	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	60天至90天	5.72	-
6	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天至180天	-	-
5	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
6	180天(含)-397天(含)	28.61	-
7	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
8	合计	99.37	-

4、报告期期末债券投资组合  
 (1)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,016,320.58	40.07
6	中期票据	-	-
7	待回存单	49,856,722.62	28.53
8	其他	-	-
9	合计	119,872,062.20	68.60
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

(2)按摊余成本占本基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

序号	债券代码	债券名称	持仓数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111620062	16国开行062	600,000	49,856,722.62	28.53
2	041600004	16国债04	100,000	10,034,473.22	5.74
3	041572006	16国开债06	100,000	10,001,469.89	5.72
4	011599441	16豫工	100,000	10,000,107.25	5.72
5	041569013	16国债03	100,000	9,997,189.27	5.72
6	041569026	16国债06	100,000	9,997,183.02	5.72
7	041569046	16国债02	100,000	9,994,808.56	5.72
8	011598884	16国开债	100,000	9,991,099.28	5.72

## 5、“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
报告期内偏离度的最大值(20个交易日内)占资产净值比例	-
报告期内偏离度最高值	0.0280%
报告期内偏离度最低值	0.0140%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0126%

6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细  
 本基金本报告期末未有资产支持证券。

## 7、 投资组合报告附注

(1)本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计价分红,使其基金份额净值维持在1.0000元。

(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。

(3)本报告期内,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。

## (4)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收申购款项	-
3	应收利息	1,489,751.62
4	应收股利	-
5	其他应收款	-