

信息披露Disclosure

国寿安保鑫钱包货币市场基金更新招募说明书摘要

(2016年第2号)

国寿安保鑫钱包货币市场基金（以下简称“本基金”）根据2015年9月21日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国寿安保鑫钱包货币市场基金注册的批复》（证监许可[2015]2161号）注册并进行募集。本基金的基金合同于2015年10月21日生效。本基金为契约型开放式基金。

重要提示

国寿安保基金管理有限公司保证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。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。

本基金的基金合同于2015年10月21日生效。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金投资于货币市场,每万份基金已实现收益/7日年化收益率会因为货币市场波动等因素产生波动。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,基金管理人不在保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券市场产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统风险、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人等在本基金实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等。本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。投资者有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担负责。

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。

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

本更新招募说明书所载内容截止日为2016年10月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国寿安保基金管理有限公司
住所:上海市虹口区丰镇路906号3幢306号
办公地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层
法定代表人:刘慧敏
设立日期:2013年10月29日
注册资本:5.88亿元人民币
存续期间:持续经营
客户服务电话:4009-258-258
联系人:耿晔晔

国寿安保基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准设立。公司股东为中国人寿资产管理有限公司,持有股份88.03%;AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(安保本资本管理有限公司),持有股份14.97%。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

刘慧敏女士,董事长,博士。曾任中国证监会办公厅副主任,上海证券交易所副总经理,国泰君安证券有限公司总裁兼副董事长,中国人寿资产管理有限公司副总裁、总裁;现任中国人寿保险(集团)公司副总裁、中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事长。

尹笑先生,董事,博士。曾任农业银行总行信贷部乡镇企业处、综合处、信贷二部制度检查处处长,办公室副主任、主任,农业银行广东省分行副行长、行长,农业银行总行资产处中部负责人(正局级),特殊资产经营部总经理(正省行级)等。现任中国人寿资产管理有限公司党委委员、副总裁。

左季庆先生,董事,硕士。曾任中国人寿资金运用中心债券投资部总经理助理,中国人寿资产管理有限公司债券投资部总经理助理、总经理,中国人寿资产管理有限公司固定收益部总经理,并担任中国交易商协会债券专家委员会副主任委员;现任国寿安保基金管理有限公司总经理、国寿财富管理有限公司董事。

叶蕾女士,董事,硕士。曾任中华全国工商业联合会国际联络部副处长;现任澳大利亚安保集团北京代表处首席代表、中国人寿养老保险股份有限公司董事、国寿财富管理有限公司董事。

彭雪峰先生,独立董事,博士。曾任北京市燕山区律师事务所副主任律师,北京市第四律师事务所律师;现任北京大成律师事务所律师、主任。

杨金观先生,独立董事,硕士。曾任中央财经大学教务处处长、会计学院党总支书记兼副院长;现任中央财经大学会计学院教授。

周黎安先生,独立董事,博士。曾任北京大学光华管理学院副教授;现任北京大学光华管理学院应用经济系主任、教授。

2、基金管理人监事会成员

杨建海先生,监事长,学士。曾任中国人寿保险公司办公室综合处副处长,中国人寿保险(集团)公司办公室总务处处长,中国人寿资产管理有限公司办公室副主任、监审部副总经理(主持工作),中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表监事、监审部总经理。现任中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表监事、办公室(党委办公室)主任。

张彬女士,监事,硕士。曾任毕马威华振会计师事务所审计员、助理经理、高级经理;部门负责人;现任国寿安保基金管理有限公司监察稽核部总经理。

马胜强先生,监事,硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司人力资源部助理、业务主管;现任国寿安保基金管理有限公司综合管理部助理。

证券代码:002821

证券简称:凯莱英

公告编号:2016-005

凯莱英医药集团(天津)股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及全体董事会成员保证公告内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动情况的说明

凯莱英医药集团(天津)股份有限公司(以下简称“公司”)股票连续三个交易日(2016年11月30日、2016年12月1日、2016年12月2日)收盘价涨幅偏离值累计超过20%。根据《深圳证券交易所交易规则》的规定,公司股票交易异常波动的情况。

二、对重要问题的关注、核实情况说明

1、公司前期所披露的信息,不存在需要更正、补充之处。

2、公司未发生近期公开传媒报道了可能或已经对公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息。

3、公司已披露的经营情况,内外部经营环境未发生重大变化。

4、公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的披露而未披露的重大事项,或处于筹划阶段重大事项。

5、控股股东、实际控制人在股票交易异常波动期间不存在买卖公司股票的情形。

6、公司不存在违反公平信息披露的情形。

7、是否存在应披露而未披露信息的说明

公司董事会确认,公司目前没有任何根据《深圳证券交易所股票上市规则》有关规定应予以披露而未披露的事项或与事项有关的筹划、商谈、意向、协议等;董事会也未获悉公司有根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关規定应予以披露而未披露的、对公司股票交易价格产生较大影响的信息;公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

四、风险提示

(一)公司提醒投资者特别关注公司于2016年11月18日在指定信息披露媒体披露的《凯莱英医药集团(天津)股份有限公司上市首日风险提示公告》(公告编号:2016-001)中所列示的公司主要风险因素及公司首次公开发行股票招股说明书“第四节风险因素”等有关章节,并特别关注上述风险提示的描述。上述风险因素将直接或间接影响本公司的经营业绩。

本公司再次特别提醒投资者务必认真注意以下风险因素:

1、临床阶段项目运营风险

发行人的临床阶段项目主要为制药企业提供新药研发外包服务,是发行人拓展商业化阶段项目的基础。发行人临床阶段项目2013年至2016年上半年实现营业收入分别为27,798.97万元、34,296.84万元、46,968.00万元和14,568.04万元,占公司当年主营业务收入比例分别为15.13%、47.98%、56.43%和30.96%。

由于临床新药研发具有较高结果的不确定性,单个临床阶段项目具有不可持续性且项目规模较小。为有序推动新药研发外包业务的发展,发行人需积累大量临床阶段项目。全球制药企业的医药研发预算容易受外部经济周期的影响,经济危机时对新药研发外包业务的步伐“双刃剑”。一方面国际制药企业为缓解财务压力,在经济危机期间加快外包专业化企业的步伐;另一方面若世界经济持续下行甚至危机加剧,制药企业可能被迫大幅削减新药研发支出、延迟研发计划并控制新药研发外包数量,导致该领域市场需求增长放缓甚至减少,由此对发行人临床阶段项目业务带来不利影响。

2、商业化阶段项目运营风险

发行人的商业化阶段项目主要为制药公司的上市药物提供工艺优化的规模生产。相比临床阶段项目,虽然商业化阶段项目前期投入较大,但能带来稳定持续的收入,降低发行人整体运营成本。发行人商业化阶段项目2013年、2014年、2015年及2016年上半年实现销售收入分别为23,766.72万元、33,846.87万元、32,088.21万元和30,686.16万元,占当期发行人主营业务收入的比例为44.06%、47.35%、38.64%和65.22%。

3、高级管理人员

刘慧敏先生,董事长,博士。简历同上。

李季庆先生,总经理,硕士。简历同上。

廖梦玉先生,督察长,硕士。曾任中国人寿保险公司资金运用中心基金投资部副总监,中国人寿资产管理有限公司交易管理部高级经理,中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部副总经理(主持工作);现任国寿安保基金管理有限公司督察长。

封雪梅女士,总经理助理,硕士。曾任中国工商银行股份有限公司经理,大成基金管理有限公司高级经理,信达澳银基金管理有限公司总经理助理兼机构业务总监;现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

桑迎先生,基金经理,硕士研究生。2002年7月至2003年8月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年11月至2008年1月,任职于华夏银行总行资金部,担任交易员;2008年2月至2013年12月,任职于嘉实基金,历任交易员、基金经理。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,拟任现国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保宝益货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

左季庆先生:国寿安保基金管理有限公司董事、总经理。

董蕾倩女士:国寿安保基金管理有限公司投资管理部总经理。

殷殿菊女士:国寿安保基金管理有限公司研究部总经理。

张琦先生:国寿安保基金管理有限公司股票投资部总监。

黄力先生:国寿安保基金管理有限公司基金经理。

吴坚先生:国寿安保基金管理有限公司基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

名称:广发银行股份有限公司
住所:广州市越秀区东风东路713号
办公地址:广州市越秀区东风东路713号
法定代表人:杨明生
设立日期:1988年7月8日
组织形式:股份有限公司
注册资本:154亿元人民币
存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》,证监许可[2009]363号

联系人:周小晶
联系电话:(010)16516962

广发银行股份有限公司成立于1988年,是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一,总部设于广东省广州市,注册资本154亿元。二十多年来,广发银行行风沐雨,艰苦创业,以自己不断壮大的发展历史,见证了中国经济腾飞和金融体制改革的一个个脚印。

2016年3月1日,中国人寿发布公告,公司与花旗集团及IBM Credit签订了相关收购协议,拟以6.39元/股的价格,收购后者合计持有的广发银行36.48亿股,总价约为233.12亿元。目前,中国人寿持有广发银行约67.29亿股,持股比例43.68%,为广发银行第一大股东。

截至2015年12月31日,广发银行总资产18365.67亿元,较年初增幅11.44%;总负债17,390.47亿元,叫年初增幅11.43%;实现营业收入54735.6元,同比增长22.61%;拨备前利润325.55亿元,同比增长34.15%。据英国《银行家》杂志2015年全球银行排名,本行按一级资本列92位,首次进入百强,五年來大幅提高126位。

(二)主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设业务运行处、监控管理处、期货业务处和产品营销处,部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格,部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人李树刚先生,经济学硕士,高级经济师,从事托管工作十七年,托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部运作中心副处长,全球资产托管处副处长,全球资产托管处副处长(主持工作)等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015年1月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部副总经理,现主持部门工作。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1、直销机构

(1)国寿安保基金管理有限公司
名称:国寿安保基金管理有限公司
住所:上海市虹口区丰镇路906号3幢306号
办公地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人:刘慧敏
客户服务电话:4009-258-258
传真:010-50850777
联系人:孙瑶

(2)国寿安保基金管理有限公司网上直销系统
(https://egsfunds.com.cn/etrading/)

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销售机构销售本基金,并及时公告。

2、其他销售机构

各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。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销售机构销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构

名称:国寿安保基金管理有限公司
住所:上海市虹口区丰镇路906号3幢306号
办公地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人:刘慧敏
客户服务电话:4009-258-258
传真:010-50850966
联系人:于晓晓

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600

联系人:安冬
经办律师:安冬、孙睿
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17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17层

01-12室
法人代表:毛敏宁
电话:010-58153000
传真:010-58188298
联系人:郭燕

经办注册会计师:章红、郭燕
四、基金的名称

国寿安保鑫钱包货币市场基金

五、基金的类型

货币型

六、基金的投资目标

在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。

七、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,具体如下:

(一)现金;

(二)期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;

(三)剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;

(四)中国证监会、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。

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。

八、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,分析和判断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)资产配置策略

基金管理人主要采取自上而下的方式,通过对研究宏观经济和资本市场进行深入研究,综合考虑市场流动性状况、存款银行的信用资质、信用债券信用评级及其他资产的收益率水平和流动性特征,设定各类资产合理的配置比例和组合的平均剩余期限。

(二)利率预期策略

由于短期利率对于基金资产有重要影响,基金管理人将持续跟踪分析货币市场短期利率变化,以根据形势变化对基金资产做出调整等指标。

具体而言,基金管理人将持续跟踪分析宏观经济及流动性等指标,在对宏观经济走势、流动性状况及宏观经济政策进行深入分析基础上,准确把握短期利率走势并做出及时反应。一般说来,预期利率上涨时,将适当缩短组合的平均剩余期限;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。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,可以增加短期回购和存款资产的比重,适度降低债券资产的比重;预期利率下降,将降低短期回购和存款资产的比重,增加债券资产的比重。

(三)利率品种投资策略

基金管理人将对国内外宏观经济形势研究基础上,对利率期限结构和债券市场变化趋势进行深入分析和预测,基于利率品种的收益风险特征调整债券组合平均剩余期限。确定债券组合平均剩余期限后,运用量化分析技术,选择合理的期限结构配置策略。

(四)信用品种投资策略

基金管理人参考外部信用评级结果,在公司内部的信用评级体系基础上,对市场公开发行的所有短期融资券、中期票据、企业债等信用品种进行认真研究和筛选,形成信用品种基础池。结合本基金的投资需要,通过对到期收益率、剩余期限、流动性等综合分析,挑选合适的短期信用品种进行投资。

(五)银行定期存款投资策略

在组合投资过程中,本基金将在综合考虑信用等级成本收益的基础上,尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围,通过向交易对手询价基础上,挖掘出报价较高的多家银行进行银行定期存款投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险。

(六)杠杆投资策略

基金管理人将在对国内外宏观经济形势研究基础上,对利率期限结构和债券市场变化趋势进行深入分析和预测,基于利率品种的收益风险特征调整债券组合平均剩余期限。确定债券组合平均剩余期限后,运用量化分析技术,选择合理的期限结构的配置策略。

(七)流动性管理策略

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基金流动性的管理因素,建立组合流动性监控管理体系,实现对基金资产流动性的实时管理。

本基金将通过对市场结构、市场冲击情况、主要资产流动性增加风险分析等多种方式对流动性进行定量定性分析,在进行组合优化时增加流动性约束条件,在兼顾基金收益的前提下合理地控制资产的流动性风险,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、持有高流动性品种、正向回购、降低组合平均剩余期限等方式提高基金资产整体的流动性。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:7天通知存款利率(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7天通知存款利率(税后)作为业绩比较基准。7天通知存款利率由中国人民银行公布,如果7天通知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开始生效。

如果今后法律法规发生变化,或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,基金管理人可依循维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对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,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日内在指定媒介上予以公告,且无需召

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,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的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。

基金管理人根据本基金合同规定,复核了本报告中的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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2016年9月30日,报告期间为2016年7月1日至9月30日。本报告财务数据未经审计。

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	固定收益类资产	69,897,218.26	17.22
2	货币性资产	69,897,218.26	17.22
2.1	买入返售金融资产	52,000,388.00	12.82
2.2	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	190,916,322.14	47.06
4	其他资产	92,871,417.80	22.89
5	合计	458,686,362.26	100.00

2、报告期债券回购融资情况

1	报告期内债券回购融资余额	0.67	
	其中:买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	—	—

注:本基金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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120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(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	33.04	-
2	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	4.50	-
2.1	30天以内<=30天	7.38	-
2.2	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	4.91	-
3	60天以内<=60天	24.43	-
3.1	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
4	90天以内<=90天	7.82	-
4.1	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
5	120天以内<=397天(含)	4.94	-
5.1	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率资产	-	-
6	合计	77.33	-

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5、报告期末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	国家债券	-	-
2	地方政府债	-	-
3	金融债	59,363,909.18	14.76
3.1	政策性金融债	59,363,909.18	14.76
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	9,993,300.17	2.47
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	69,897,218.26	17.22
10	剩余存续期超过397天的浮动利率资产	39,300,507.20	9.85

6、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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160239	16国开09	200,000	20,093,401.98	4.94
2	130204	13国开34	200,000	19,986,964.30	4.93
3	160315	16国信15	200,000	19,913,562.81	4.91
4	01160922B	16国新债SCP001	100,000	9,993,300.17	2.47

7、“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(在0.25%-0.5%间的次数)	-
报告期内偏离度的绝对值	-
报告期内偏离度的绝对值	0.1018%
报告期内偏离度的最低值	0.0684%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0767%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

8、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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。