

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

2017年第1期

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
二〇一七年四月
重要提示

大成月月盈短期理财债券型证券投资基金由大成理财21天债券型发起式证券投资基金通过基金转型变更而来。基金转型经大成理财21天债券型发起式证券投资基金份额持有人大会决议通过。自2014年9月12日起,由《大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》修订而成的《大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》生效。

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备案,但并不表明中国证监会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。

本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资者申购基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)已经本基金托管人复核。本招募说明书(更新)所载内容截至日为2017年3月12日(其中人员变动内容的更新以公告日期为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2016年12月30日,所列财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例50%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)三家公司。

法定代表人:刘卓

电话:0755-83183388

传真:0755-83199688

联系人:肖剑

(二)主要人员情况

1、公司高级管理人员

董董事:

刘卓先生,董事长,工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司;2007年6月,任哈尔滨银行股份有限公司执行董事;2008年8月,任哈尔滨银行股份有限公司董事兼秘书;2012年4月,任哈尔滨银行股份有限公司副董事长;2012年11月至今,任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生,副董事长,国际法学硕士。1991年7月至1993年2月,任职于共青团河南省委;1993年3月至12月,任职于深圳市国际经济与法律咨询有限公司;1994年1月至6月,任职于深圳市蛇口律师事务所;1994年7月至1997年4月,任职于蛇口招商港务股份有限公司;1997年5月至2015年1月,先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部研究员,南方总部机构管理部副经理,光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理,资产管理总部投资部副经理(主持工作),法律合规部副经理,零售交易业务总部副经理;2014年10月,任大成基金管理有限公司董事;2015年1月起任大成基金管理有限公司副董事长。
罗登攀先生,董事、总经理,耶鲁大学经济学博士。注册金融分析师(CFA),金融风险管理师(PRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师,以及SLCG证券诉讼及咨询公司合伙人;2009年至2012年,任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员,机构创新处负责人,兼任国家“千人计划”专家;2013年2月至2014年10月,任中信并购基金管理有限公司董事兼总经理,执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2016年3月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。2017年2月17日起代为履行大成基金管理有限公司督察长职务。

周雄先生,董事,金融学博士,北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士(EMBA),上海黄浦区政协委员。1987年8月至1993年4月,任厦门大学财经系教师;1993年4月至1996年8月,任华夏证券有限公司厦门分公司经理;1996年8月至1999年2月,任人民日报社事业发展局企业管理处副处长;1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司,历任副总裁、总裁,现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生,董事,硕士研究生。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司党委委员、总裁助理,兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。2012年6月起,兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士,独立董事,经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师,中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生,独立董事,法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任、博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士,独立董事,金融学博士,现任东北财经大学讲师,教研室主任,东北财经大学金融学院教学团队负责人,东北财经大学开发金融研究中心助理研究员,主要从事金融产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目,并负责撰写项目总结报告,在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生,独立董事,博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授(博士生导师)和北京大学光华管理学院副教授(博士生导师),金融系联合系主任、院长助理,北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年,并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会:

陈希先生,监事长,中国人民大学经济学专业研究生,高级经济师。2006年被亚洲风险与危机管理协会授予“企业风险管理师”资格。2000年1月,先后任中国银河证券有限责任公司审计部、合规(法律)部总经理;2007年1月,任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁、党委书记;2010年7月,兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车产业创业投资有限责任公司董事;2012年6月,兼任镇江银河创业投资有限公司董事长;2012年7月,任中国银河投资管理有限公司总裁;2015年1月起,任大成基金管理有限公司监事长。

蒋卫强先生,职工监事,经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司,历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监,现任风险管理部总监。

吴旻女士,职工监事,文学学士,中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三井银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分行。2010年6月加入大成基金管理有限公司,历任计划财务部高级会计师、总监助理,现任计划财务部副总监。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

其他高级管理人员:

肖剑先生,副总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委(政府)办公室副主任,深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股有限公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司,任公司副总经理。

温敬敏先生,副总经理,哈佛大学法学博士。曾任职于Huntton & Williams美国及国际律师事务所。曾任中银国际投行业务副总裁、香港三山投资公司董事总经理、标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司,任首席战略官,2015年8月起任公司副总经理。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

周立新先生,副总经理,大学本科学历。曾任新疆精河县县委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州人民政府办公室副主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司,历任客户服务中心总监助理、市场部副经理、上海分公司副经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理。2015年8月起任公司副总经理。

谢晓凤先生,副总经理,哈佛大学公共行政管理硕士。曾任财政部世界银行司科长,世界银行中国执事技术顾问,财政部办公厅处长,全国社保基金理事会办公厅处长,海外投资部副主任。2016年7月加入大成基金管理有限公司,2017年2月起任公司副总经理。

姚念栋先生,副总经理,英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行、曾任世界银行咨询顾问、国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家、原黑龙江省招商局副局长,黑龙江省商务厅副厅长,中国人民银行货币政策二司副巡视员,中国人民银行货币政策司副司长,中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司,任首席经济学家,2017年2月起任公司副总经理。

陈翔凯先生,副总经理,香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司、平安保险集团总部。曾任华安财产保险股份有限公司高级投资经理,国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监,招商证券资产管理有限公司副总经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司,2017年2月起任公司副总经理。

2、本基金基金经理

(1)现任基金基金经理

张文平先生,南京大学管理学硕士,注册会计师,证券从业年限5年。2009年10月至2011年5月就职于毕马威企业咨询有限公司南京分公司审计部;2011年起加入大成基金管理有限公司,历任固定收益部助理研究员。2013年11月25日至2015年3月5日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理助理。2015年3月7日至2016年11月18日担任大成景祥分级债券型证券投资基金基金经理。2015年6月23日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月1日起任大成现金场内实时申赎货币市场基金基金经理及大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2015年11月24日起任大成景沛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月6日起任大成添利宝货币市场基金基金经理,自2016年9月6日起任大成景安短融债券型证券投资基金和大成现金增利货币市场基金基金经理。2016年9月20日起任大成景辉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国。

(2)历任基金基金经理

历任基金基金经理姓名	管理本基金时间
谢晓	2012年11月20日至2014年4月4日
程海清	2013年2月12日至2015年6月30日

3、公司固定收益投资决策委员会

公司固定收益投资决策委员会由4名成员组成,设固定收益投资决策委员会主席1名,其他委员3名。名单如下:

陈翔凯,公司副总经理,固定收益投资决策委员会主席;王立,基金经理,固定收益部总监,固定收益投资决策委员会委员;谢晨,交易管理部副总监,固定收益投资决策委员会

委员;张文平,基金经理,固定收益投资决策委员会委员。上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人:王冰
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566
(二)基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对一、一对一)、社保基金、保险资金、OPFI、ROFII、ODII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2016年12月31日,中国银行已托管534只证券投资基金,其中境内基金500只,ODII基金34只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAP01/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运用基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人存在违规行为的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

1、直销机构

大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199688
联系人:王为开
公司网址:www.dcfund.com.cn
全国统一客户服务号码:400-888-5558(免固话长途费)
大成基金深圳投资理财中心
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人:曹迪、王志玲、小白雪
电话:0755-22223523/22223171/22223565
传真:0755-83195235/83195242/83195232
邮编:518040

2、代销机构

1、中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
联系人:王娟
电话:010-66594909
传真:010-66594942
网址:www.boc.cn
2、杭州银行股份有限公司
办公地址:杭州庆春路46号
法定代表人:吴太普
联系人:严峻
联系电话:0571-85108309
客服电话:95398
网址:www.hzbank.com.cn
3、洛阳银行股份有限公司
注册地址:洛阳市洛龙区开元大道256号
办公地址:洛阳市洛龙区开元大道256号
客服电话:0379-96699
法定代表人:王建甫
联系人:胡艳丽
电话:0379-65921977
传真:0379-65921851
网址:www.bankofluoyang.com.cn
4、国海证券股份有限公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
客服电话:95563(全国)、0771-96110(广西)
网址:www.gnqz.com.cn

5、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
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
电话:021-20835785
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com
6、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195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:潘世伟
电话:021-54509098
传真:021-64383798
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.fund123.com

8、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号中关村金融大厦(丹棱soho)1008
法定代表人:赵荣春
联系人:魏新
网站:www.qianjing.com
客户服务电话:400-893-6885
9、上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼?
联系人:宁博宇
网站:www.lufunds.com
客户服务电话:40082119031
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本基金,并及时进行公告。

(二)注册登记机构

名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:苗倩
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
住所:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:靳庆军、冯义
联系人:冯义
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展展大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:薛岚、俞伟敏
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:俞伟敏
四、基金的投资目标
大成月月盈短期理财债券型证券投资基金(由大成理财21天债券型发起式证券投资基金通过基金转型变更而来)
五、基金的投资类型
基金类型:契约型
六、基金的投资方式
基金运作方式:开放式
七、基金的投资目标
以保障基金资产的安全性和适当流动性为首要目标,追求高于业绩比较基准的稳定收益。

注: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)的银行定期存款和同业存款、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券(国债、金融债、公司债、企业债、次级债等)、中期票据、资产支持证券、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、超短期融资券,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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。
九、基金的投资策略
1、组合平均剩余期限策略
通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析、申购、赎回现金流情况等因素的综合分析,决定投资、逆回购、银行存款等资产的配置比例,保持组合的合理剩余期限。
2、资产配置
本基金将短期金融工具按剩余期限分为4类,3个月以下、3-6个月、6-9个月、9个月以上品种,而各期限品种内部按投资工具的特征可划分为回购、短期债(含国债、金融债、企业债)、央行票据三类。本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上,结合预先制定的组合平均期限范围确定各类资产配置。
3、品种选择
本基金管理人通过综合考虑品种流动性、收益率的基础上,选择品种构建组合。具体来说,遵循以下原则:
(1)对于短期信用债券和央行票据原则上采取买入并持有的投资策略,但持有过程中会结合短期利率走势、信用度和与回购收益率比较分析,综合评估其在收益性和流动性方面的投资价值。选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的品种。
(2)回购以短期品种为主,具体期限的选择可评估品种间利率期限结构的合理性,选择收益率相对高的品种进行投资。
(3)对于含回售条款的债券,本基金将仅买入距回售日不超过397天以内的债券,并在回售日前进行回售或者卖出。
4、其他衍生工具投资策略
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适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,在充分考选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通过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。

十、基金的业绩比较基准
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。
如果法律法规或未来市场发生变化导致业绩比较基准不再适用,或有其他更具代表性、更科学客观的或者更能作为市场普遍接受的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可依据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并及时公告,并在更新的招募说明书中列示。
十一、基金的风险收益特征
本基金属于短期理财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、及普通债券型证券投资基金。
十二、基金的投资组合报告
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。
基金托管人中国银河根据基金合同规定,于2017年3月30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、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据取自本基金2016年第四季度报告,截至2016年12月31日。(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	固定收益投资	330,817,847.75	25.02
其中:债券	330,817,847.75	25.02	
资产支持证券	-	0.00	
2	买入返售金融资产	387,475,438.34	27.66
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00	
3	银行存款和拆借资产合计	646,341,691.55	47.82
4	其他各项资产	5,500,418.48	0.40
5	合计	1,364,136,385.12	100.00

3. 品种选择

本基金管理人通过综合考虑品种流动性、收益率的基础上,选择品种构建组合。具体来说,遵循以下原则:

- (1) 对于短期信用债券和央行票据原则上采取买入并持有的投资策略,但持有过程中会结合短期利率走势变动、信用度和与回购收益率比较分析,综合评估其在收益性和流动性方面的投资价值。选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的品种。
- (2) 回购以短期品种为主,具体期限的选择可评估品种间利率期限结构的合理性,选择收益率相对高的品种进行投资。
- (3) 对于含回售条款的债券,本基金将仅买入回售日不超过397 天以内的债券,并在回售日(前)进行回售或者卖出。
4. 其他衍生工具投资策略

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通过利用其他衍生产品进行套期、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。

十、基金业绩比较基准

注:报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为本报告期内每个交易日融资金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:“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。
3、期末基金组合剩余期限
(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
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。
(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	10.84	5.53
其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	0.00	0.00	0.00
2	30天至60天	15.37	0.00
其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	0.00	0.00	0.00
3	60天至90天	60.11	0.00
其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	0.00	0.00	0.00
4	90天至120天	0.00	0.00
其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	0.00	0.00	0.00
5	120天至180天(含)	7.00	0.00
其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	0.00	0.00	0.00
合计	100.32	100.32	5.53

报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本报告期内本基金均未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。
4、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	国债	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债	69,999,219.25	5.44
其中:政策性金融债	69,999,219.25	5.44	
4	企业债	-	0.00
5	企业短期融资券	219,885,120.76	17.10
6	中期票据	49,963,507.74	3.88
7	同业存单	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	330,817,847.75	26.43
10	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5	120天(含)~397天(含)	7.00	0.00
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债		0.00	0.00
合计		101.22	6.52

报告期末投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金各均未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

4. 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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	60,009,219.26	5.44
4	其中:政策性金融债	60,009,219.26	5.44
5	企业债券	-	0.00

5	企业中期票据	219,006,120.76	17.10
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	40,963,507.74	3.88
8	其他	-	0.00
9	合计	339,817,847.76	26.43
10	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	占基金资产净值比例(%)
1	011608906	16苏文通债CP019	1,000,000	99,920,049.19	7.77
2	160204	16豫开04	600,000	60,002,053.20	4.67
3	111610389	16兴达债CP089	500,000	49,963,507.74	3.88
4	011609264	16鲁鲁债TC003	300,000	29,991,082.91	2.33
5	011609903	16光明力债SCP016	300,000	29,979,772.65	2.33
6	011608885	16联融债SCP006	300,000	29,977,872.30	2.33
7	011608994	16中农利债SCP006	200,000	19,993,210.97	1.55
8	160201	16豫开01	100,000	9,997,156.05	0.78
9	041605028	16康农CP001	100,000	9,994,160.84	0.78

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值偏离度

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值偏离

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.04444%
报告期内偏离度的最低值	-0.11333%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0285%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本报告期内本基金均未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。
报告期内正偏离度的绝对值