

工银瑞信添益快线货币市场基金更新的招募说明书摘要

(2017年第1号)

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示
本基金经中国证券监督管理委员会2014年10月8日证监许可【2014】11024号文准予注册。本基金基金合同生效日期为2014年10月22日。

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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的数量、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基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

投资者购买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，基金管理人不能保证基金一定盈利，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，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、利率风险、信用风险、再投资风险、流动性风险、操作风险、其他风险及本基金特有风险等。

本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金品种。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券型基金，也低于混合型基金与股票型基金。

本招募说明书基金合同和基金招募说明书并经过中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件。基金投资者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完全承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

基金的投资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对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺恪尽职守、勤勉尽责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。

本招募说明书所载基金业绩数据日期为2017年4月21日，有财务数据和净值表现数据截止日期为2017年3月31日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经过审计复核。

（一）基金管理人概况
名称：工银瑞信基金管理有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号/层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
邮政编码：100033
法定代表人：郭树华
成立日期：2005年6月21日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]193号
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
联系人：宋鑫怡
联系电话：400-811-9999
股权结构：中国工商银行股份有限公司占注册资本的90%；瑞士信贷银行股份有限公司占注册资本的10%。

存续期间：持续经营
（二）基金管理人主要人员情况
1. 董事会成员
尚军先生，董事长，中国工商银行战略管理与投资者关系部资深专家，专职派出董事。复旦大学工商管理（国际）硕士，高级经济师。历任中国工商银行河南郑州分行党委书记、国际部副总经理，河南分行国际部副总经理，副行长兼、国际业务处处长，河南分行副行长、党委书记、行长等职务。

Neil Harvey 戴维先生，董事，美国上海信投（香港）国际董事总经理，常驻香港。戴先生是瑞信中国区主席兼首席CEO，同时也是亚太区业务管理主席，并作为亚太区运营委员会成员。戴先生从事投资银行和资产管理业务长达三十一年，在亚太地区工作二十一年，拥有对新兴市场的广泛深入的丰富经验和深入了解。戴先生在瑞信工作了一十七年，担任过很多要职，之前为瑞信中国区新兴市场资产管理部董事兼首席，之后为瑞信亚太区新兴市场管理担任过首席负责人。另外，他在瑞信和其他公司都担任过要职，负责澳大利亚、非洲、日本、拉美、中东、土耳其和其他地区的业务。

郭树华女士：董事，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事长。历任中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副经理，中国工商银行总行资产管理处处长、副总经理兼投资总监。

王一心女士：董事，高级经济师，中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家，专职董事。历任中国工商银行行专项融资部（公司业务二部、营业部）副总经理；中国工商银行营业部 历任副处长、处长；中国工商银行总行技术设备部信贷部。

王莹女士：董事，高级会计师，中国工商银行集团派驻子公司董监事办公室专家，专职派出董事。于2009年11月取得美国加州注册会计师（Certified Internal Auditor）资格证书。历任中国工商银行国际业务部外汇清算处负责人、中国工商银行清算中心外汇清算处负责人、副处长，中国工商银行稽核监察局外汇业务稽核处副处长、处长，中国工商银行内部审计局境外审计处副处长，工行悉尼分行内部审计师，风险专家。

尹洪强先生，独立董事，经济学博士，上海财经大学法学院教授，博士生导师，享受国务院政府特殊津贴专家。兼任北京大学中国保险与社会保障研究中心主任、中国金融学会学术委员会常务理事、常务理事、教育部高教司高等学校哲学社会科学类专业教学指导委员会委员、美国国际保险学会董事会成员、学术主持人、美国C.V. Starr 高级教授、曾任亚太风险与保险学会主席、美国国家经济研究局、美国国际安纳大学、美国佩伯大学客座教授。发表过学术论文、专著、学术刊物上发表论文100多篇，主持过20多项由国家部委和国际著名机构委托的科研课题。

Jane DeBoiseau女士，独立董事，香港大学艺术系博士，历任银行家协会人员（1998年与德意志银行合并）董事总经理，罗门丁·古根海姆基金会副主席及项目总监、香港政府委任的观感委员会成员、香港西九文化管理局主席、香港政府委任委员。2003年至今担任香港渣打银行董事兼渣打董事及主席，2008年至今担任亚洲亚洲艺术文献馆主席。

2. 监事会成员
郭剑峰先生：监事，金融学学士双硕士。2005年12月起，郭剑峰先生任职于中国工商银行监事办公室，先后担任综合管理处处长、监督员及监事会办公室副主任，主要负责风险、内控及合规管理监督的监督检查工作。2014年6月起，郭剑峰先生担任为中国工商银行稽核监察局、监事会办公室、中国工商银行集团派驻子公司董监事办公室高级专家，专职派出董事。

黄敏女士：监事，金融学学士。黄敏女士于2006年加入Credit Suisse Group（瑞士信贷集团），先后担任全球投资银行战略部助理副经理、亚太区投资银行战略部副经理、中国区投行首席运营官，资产管理大中国区首席运营官，现任资产管理大中国区负责人。

洪涛女士：监事，硕士，ACCA 非执业会员。2005年至2008年任安永华明会计师事务所高级审计员；2008年至2009年任民生证券有限责任公司稽核稽核部总主管；2009年6月加入工银瑞信法律合规部，现任内控稽核部副总监。

程俊女士：监事，硕士。2000年至2009年任职于中国人民大学，历任副科长、科长、校办副主任。2009年12月入职于北京市教委工作，任干部处副调研员。2011年加入工银瑞信战略发展部，现任副总监。

程璇女士：监事，硕士。2001年至2003年任职于富友证券财务部。

2003年至2005年任职于银河基金，担任注册登记专员。2005年加入工银瑞信运作部，现任工银瑞信运作部联席总监。

3. 高级管理人员
郭树华女士：总经理，简历同上。

朱春艳女士：董事，国际注册内部审计师，现任工银瑞信基金管理有限公司督察长，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事。1997年-1999年任中国华融信托投资公司证券总部经理，2000年-2005年任中国华融资产管理公司投资银行部、证券业务部高级副经理。

江明波先生：硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司固定收益投资总监、工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事。2000年7月至2001年11月，任职于长城证券有限责任公司，担任研究员；2001年12月至2006年12月，任职于鹏华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、普天债券基金基金经理、社保组合组合、社保均衡组合基金经理、机构理财部总监助理、固定收益小组负责人。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

杜海涛先生：硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事。1997年7月至2002年9月，任职于长城证券有限责任公司，担任研究员、债券（金融工程）研究员；2002年10月至2003年9月，任职于宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金基金经理助理；2003年6月至2006年3月，任职于招商基金管理有限公司，历任研究员、基金基金经理。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

赵超英女士：博士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。1999年10月至2001年12月，任职于中国工商银行海淀支行，从事国际业务；1994年9月至2002年4月，任职于中国工商银行北京市分行国际业务部，历任综合科科长、国际业务部副经理；2002年5月至2006年6月，任职于中国工商银行银行牡丹中心，历任市场营销部副经理、清算部副经理。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

4. 基金基金经理
王朔先生，7年证券从业经验，2010年加入工银瑞信，现任宏源市场资产管理部副经理。2013年11月11日至至今，担任工银货币市场基金基金经理；2014年1月27日至至今，担任工银新鑫货币市场基金基金经理；2015年7月10日至至今，担任工银瑞信添益快线货币市场基金基金经理；2015年7月10日至至今，担任工银瑞信添益快线货币市场基金基金经理；2016年9月19日至至今，担任工银瑞信添益快线货币市场基金基金经理；2016年9月19日至至今，担任工银瑞信添益快线货币市场基金基金经理；2017年4月14日至至今，担任工银瑞信添益快线货币市场基金基金经理。

本基金历任基金经理：顾欣女士，2014年10月22日至2017年3月10日管理本基金。

5. 投资决策委员会成员
郭树华女士：投资决策委员会主任，简历同上。

江明波先生，简历同上。

宋海涛先生，13年证券从业经验；曾任中信建投证券股份有限公司研究员，2007年加入工银瑞信，现任权益投资总监兼研究部副经理。2013年6月14日至至今，担任工银双利债券基金基金经理；2013年1月28日至2014年12月25日，担任工银瑞信60天理财债券基金基金经理；2014年1月20日至至今，担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至至今，担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至至今，担任工银瑞信研究精选股票基金基金经理；2014年12月16日至至今，担任工银瑞信稳健成长股票基金基金经理；2015年6月16日至至今，担任工银瑞信战略主题股票基金基金经理；2017年4月12日至至今，担任工银瑞信中国智造2025股票型证券投资基金基金经理。

欧阳靖先生，15年证券从业经验；曾任中海基金管理有限公司基金经理；2010年加入工银瑞信，现任固定收益部副经理。2010年8月16日至至今，担任工银双利债券型基金基金经理；2011年12月27日至2017年4月21日担任工银基金基金经理。2013年2月7日至2017年2月6日担任工银保本2号混合型发起式基金(自2016年2月19日起变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金)基金经理；2014年6月26日起至今担任工银瑞信保本3号混合型证券投资基金。2013年7月4日起至今担任工银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年6月26日起至今担任工银丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王莹女士，14年证券从业经验；先后在相关投资银行有限公司担任研究员，国信证券研究所担任投资分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2011年11月23日至至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2013年9月29日至至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014年10月22日至至今，担任工银瑞信瑞选行业股票型证券投资基金基金经理；2015年4月29日至至今，担任工银瑞信材料新能源行业股票型证券投资基金基金经理；2016年1月29日至至今，担任工银瑞信国家战略性新兴产业基金基金经理；2017年4月14日至至今，担任工银瑞信互联网+医疗健康主题股票型证券投资基金基金经理。

李剑峰先生，14年证券从业经验；曾任中央国债登记结算有限责任公司业务经理，高级副经理；2008年加入工银瑞信，曾任固定收益研究员、现任固定收益投资总监。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人
名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层
法定代表人：周慕冰
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传 真：010-66121816
联系人：林葛

三、相关服务机构
（一）基金份额发售机构
1. 直销机构
名称：工银瑞信基金管理有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号/层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人：郭树华
全国统一客户服务热线：400-811-9999
传真：010-66583111
联系人：赵雪莹
电话：010-66583233
公司网站：www.icbcs.com.cn

2. 销售机构
名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街66号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街66号
法定代表人：姜建清
基金托管人：姜建清
客户服务热线：95588
网址：http://www.icbc.com.cn/

基金管理人可根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的销售机构销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）基金登记机构
名称：工银瑞信基金管理有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲5号6层甲5号601、甲5号/层甲5号701、甲5号8层甲5号801、甲5号9层甲5号901
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层
法定代表人：郭树华
全国统一客户服务热线：400-811-9999
传真：010-66583100
联系人：李耀辉

（三）律师事务所及经办律师
名 称：北京德恒律师事务所
住 所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层

办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
电 话：010-52682888
传 真：010-52682898
经办律师：徐海华、刘旭志
（四）会计师事务所及经办注册会计师
名 称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住 所：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼16层
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼16层
经办注册会计师：李慧民、王珊珊
联系电话：010-58152145
传真：010-58114645
联系人：王珊珊

四、基金的名称
本基金名称：工银瑞信添益快线货币市场基金
五、基金的类型
本基金类型：货币市场基金
六、基金的投资目标
在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向
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幅存单、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货币市场工具。

在不改变基金投资目标、不改变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，不需召开份额持有人大会，其投资比例遵循届时有效法律法规相关规定。

法律合规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、不改变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，不需召开份额持有人大会，其投资比例遵循届时有效法律法规相关规定。

八、基金的投资策略
（一）投资策略
本基金将采取积极策略，使用规则、相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。

1. 利率策略
通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策的宏观政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场利率收益率曲线变化趋势。

2. 信用策略
根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平、债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险。跟踪债券发行人和债券工具本身的信用质量，并结合外部权威评级机构的信用评级结果，确定基金资产对相应债券的投资决策。

3. 资产配置策略
研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同期限品种的利率走势，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利率水平，评定不同债券品种的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类别之间的配置比例。

4. 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、信用评级等因素导致价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线判断出定价偏高或偏低的期限段，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。

5. 相对价值策略
本基金认为市场普遍存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在与这些不同参与者之间的相对价值，也是本基金发现投资机会的重要途径。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动，通过深入分析市场参与者的立场和观点，充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好等因素被忽视或市场失衡的市场失衡机会，形成相对价值投资策略，运用回购、远期交割等交易工具进行不同期限、不同品种或不同市场之间的套利交易，为本基金的投资带来增加价值。

6. 其他金融工具投资策略
本基金将密切跟踪股指期货、国债、商业承兑汇票等商品期货以及各种衍生产品的动向。当法律法规允许基金参与此类金融工具的投资，本基金将按照届时生效的法律法规，根据对该类金融工具的研究，制定本基金投资该类金融工具的投资策略，在充分考虑该品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

（二）投资管理程序
本基金管理人实行“投资决策委员会领导下的团队制”管理模式，建立了严谨、科学的投资管理流程，具体包括投资管理、投资管理、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等过程，如图1所示。

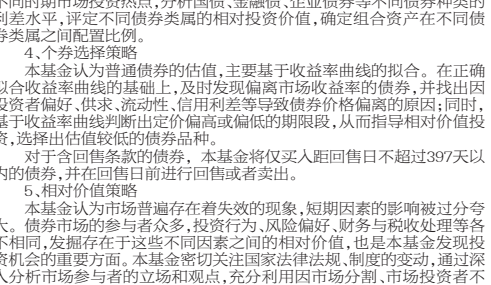


图1 固定收益证券投资管理程序
1. 投资决策委员会制定投资策略
本基金管理人在固定收益证券投资与研究方面，实行投资策略研究专业化分工制度，由基金经理与研究员组成专业小组，进行宏观经济及政策、产业结构、金融市场、单个证券等领域的深入研究，判断利率、债券信用风险、相对价值等角度，提出独立的投资策略建议，经固定收益投资决策团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益投资指导投资策略。该投资策略是公司未来一段时间内对市场利率的风险和收益预期，对公司旗下管理的所有基金或组合的固定收益类证券投资决策具有指导作用。

各个专业领域的投资策略专业小组每季度定期举行策略分析研讨会，提出下一阶段投资策略，每周定期举行策略评估会议，回顾本周的各项经济数据和重大事件，分析其对季度投资策略的影响，检讨投资策略的有效性，必要时及时调整策略。

2. 投资决策
基金经理在公司固定收益投资总体投资策略的指导下，根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等约定，制定相应的投资决策计划，报投资决策委员会审批。

3. 投资组合构建
基金经理根据投资决策委员会的决议，在权限范围内，评估债券的投资价值，选择待构建基金投资组合，并根据市场变化调整基金投资组合，进行投资组合的日常管理。

4. 交易执行
交易员负责在合法合规的前提下，执行基金经理的投资指令。基金管理人实行集中交易制度，交易指令由基金经理下达，交易员负责执行。

5. 风险监控与绩效评估
风险管理部对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行持续评估，报投资决策委员会、抄送投资决策委员会、投资决策及基金经理，并视基金的投资组合提出风险管理建议。

法律合规部对基金的投资行为进行合规性监控，并对投资过程中存在的风险进行提示。

在的风险隐患向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

九、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的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时，本基金管理人可以根据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况下调或变更业绩比较基准进行相应调整。经基金管理人和基金托管人协商一致后，基金管理人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，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险特征
本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金品种。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券型基金，也低于混合型基金与股票型基金。

十一、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（财务数据未经审计）。1. 报告期末基金资产组合情况

1	固定收益投资	4,936,663,369.44	19.58
	其中：债券	4,936,663,369.44	19.58
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,112,397,695.06	28.22
	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	13,047,903,820.58	51.77
4	其他资产	106,531,255.65	0.42
5	合计	25,202,496,742.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十二、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十三、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十四、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十五、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十六、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十七、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十八、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（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）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
2	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
3	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
4	报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例	-	4.70
5	合计	20,322,432,744.54	100.00

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日披露的债券融资余额占基金资产净值的比例略有差异，原因是基金资产净值在报告期内有所波动，而债券融资余额在报告期内是固定的。

十九、基金的投资组合情况
本报告期内为2017年1月1日起至3月31日止（财务数据未经审计）。1. 报告期末基金资产组合情况

租赁股份公司	本公司及重 陈述及重大重
公司	四川泸天化 司(以下简称“ 四川化工控股(集团)有限公司”(以下简称“化 裁定书(2017) 一、本案的 1、诉讼当事 原告:华融