

嘉实活钱钱包货币市场基金更新招募说明书摘要

(2017年第2号)

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

重要提示
嘉实活钱钱包货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2014年3月5日证监许可[2014] 260号文核准公开发售,本基金基金合同于2014年3月17日正式生效,自该日起本基金管理人开始管理本基金。投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
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《证券投资基金法》、《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。

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。

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者存款类金融机构。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2017年9月17日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

| 1. 基本信息 | |
|---------|--|
| 名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 注册地址 | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期33层09-11单元 |
| 办公地址 | 北京市建国门内大街甲8号华润大厦A座 |
| 法定代表人 | 杨红瑞 |
| 总经理 | 赵学军 |
| 成立日期 | 1999年09月26日 |
| 注册资本 | 1.85亿元 |
| 股权结构 | 中信证券股份有限公司40%、德意志资产管理(亚洲)有限公司30%、立信投资管理有限公司20% |
| 存续期间 | 持续经营 |
| 电话 | (010) 65215688 |
| 传真 | (010) 65185728 |
| 联系人 | 胡博尧 |

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准,于1999年3月26日成立,是中国第一批基金管理公司之一,是外合资基金管理公司。公司注册地上海,总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金资产管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况
邓红国先生,董事长,硕士研究生,中共党员。曾任物资部研究室、政策体制改革司副处长;中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管司、银行管理局副处长、处长、副巡视员;中国银监会银行监管三部副主任、四部主任;中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014年12月2日起任嘉实基金管理有限公司董事长。
赵学军先生,董事,总经理,经济学博士,中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所;外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

高峰先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁,美国友邦金融产品结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长,2008年至今任德意志银行(中国)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士,董事,硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、资产管理部信託经理、高级理财。2014年11月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。2016年8月至今任中诚宝捷货币经纪有限公司董事长。
Jonathan Paul Eillbeck先生,董事,英国籍,南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问,JP Morgan固定收益亚太区CFO,COO,JP Morgan Chase固定收益亚太区CFO,COO,德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生,董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理;2001年11月至今任立信投资管理有限公司董事长。

王巍先生,独立董事,美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员,美国花旗银行分析师,美国世界银行顾问,中国南方证券有限公司副总裁,万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万得集团董事长。

张维炯先生,独立董事,中共党员,教授、加拿大滑铁卢伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师,上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》主编、汤寿潜路透集团《中国商法》丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任任上海海泰基金管理公司第一、二届并购重组审核委员会委员,现兼任上海证券交易所上市公司委员会、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

朱蕾女士,监事,中共党员,硕士研究生。曾任首都医科大学教师,中国保险监督管理委员会主任科员,国都证券有限责任公司高级经理,中欧基金管理有限公司发展战略官、北

京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆祥先生,监事,经济师,硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教,长安信息产业(集团)股份有限公司董事会秘书,北京德恒有限责任公司证券主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾先强先生,监事,法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团,2003年10月至2008年6月,为国浩律师集团(北京)事务所证券律师。2008年7月至今,就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部,现任法律部总监。

宋振宇女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫处。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长,1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任督察员和公司副总经理。

王炜女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生,副总经理,硕士研究生。历任国泰证券行业研究员,国泰君安证券行业研究部副经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生,副总经理,工商管理硕士。历任元国证券深圳证券部信息信息总监,南方证券金通证券部总经理助理,南方基金运作部副总监,嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2.基金经理

(1)现任基金经理
万晓雪先生,17年证券从业经历。曾任职于中国农业银行黑龙江省分行国际业务部、市场开发处及深圳发展银行国际业务部、资金交易中心、南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员,第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理,民生证券资产管理事业部总助理兼投资研究部总经理。2007年6月6日至2009年10月20日任南方现金增利货币基金经理。2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任公司固定收益业务体系短端alpha策略组长、经济学术士,中国国籍,2013年7月5日至2014年7月16日任嘉实信用债券和嘉实增强收益定期债券基金经理,2013年9月4日至2014年9月19日任嘉实丰益策略定期债券基金经理,2013年12月11日至至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金经理,2013年12月18日至至今任嘉实活期宝货币基金经理,2014年6月27日至至今任嘉实3个月理财债券基金经理,2015年6月25日至至今任嘉实快钱货币基金经理,2017年3月29日至至今任嘉实现金添利货币基金经理,2017年5月24日至至今任嘉实货币、嘉实新金货币基金经理,2017年6月19日至至今任嘉实6个月理财债券基金经理,2014年3月17日至至今任本基金基金经理。

李曦先生,硕士研究生,8年证券从业经历。曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理,2014年12月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。2015年5月14日至至今任

嘉实安心货币、嘉实理财7天债券基金经理,2016年1月28日至至今任嘉实货币、嘉实活期宝货币基金经理,2016年4月21日至至今任嘉实快钱货币基金经理,2016年12月22日至至今任嘉实现金货币基金经理,2017年4月13日至至今任嘉实现金添利货币基金经理,2017年5月24日至至今任嘉实超短债债券基金经理。2017年5月25日至至今任嘉实货币、嘉实增鑫货币、嘉实定期宝6个月理财债券基金经理。2015年1月28日至至今任本基金基金经理。

李金灿先生,硕士研究生,具有基金从业资格,8年证券从业经历。曾任Putex Trading Ltd期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司担任债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司,曾任债券交易员,现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。2015年6月9日至至今任嘉实超短债债券和嘉实宝基金经理,2016年1月28日至至今任嘉实新金货币基金经理,2016年2月5日至至今任嘉实机构快钱货币基金经理,2016年7月23日至至今任嘉实安心货币和嘉实理财宝7天债券基金经理,2016年12月27日至至今任嘉实增鑫货币基金经理,2017年5月24日至至今任嘉实1个月理财债券基金经理,2017年5月25日至至今任嘉实活期宝货币、嘉实现金货币、嘉实3个月理财债券、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币基金经理,2017年6月29日至至今任嘉实6个月理财债券基金经理,2017年6月25日至至今任本基金基金经理。

(2)历任基金经理

无。

3.债券投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度,债券投资决策委员会的成员包括:公司固定收益业务首席投资官管雷先生、固定收益体系资深基金经理王蓓女士、万晓雪先生、胡永青先生、以及投资经理王怀麟先生、嘉实国际CIO Thomas Kwan先生。

4.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况
名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
成立时间:1987年4月20日
组织形式:股份有限公司
注册资本:489.35亿元人民币
存续期间:持续经营
注册地址:上海市浦东新区世纪大道26号华夏银行大厦1楼
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号
联系人:中信银行资产托管部
联系电话:4006800000
传真:010-85230024
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资业务、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务;保险兼业代理业务(有效期至2017年09月06日)。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动。)

中信银行(601998.SH,09988.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国际金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2006年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,以中国中信集团和中国国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国际)70.32%股权。经过三十年的发展,中信银行已成为中国资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审计并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

二、主要人员情况

孙德顺先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行(国际)董事长。此前,孙先生于2014年5月至2016年7月任本行常务副行长;2014年3月起任本行执行董事;2011年12月至2014年5月任本行副行长,2011年10月起任本行党委委员、党委书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长;2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长;1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心(北京)等单位工作,期间,1995年12月至2005年11月在中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心(北京)总经理;1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学位。

张强先生,中信银行副行长,分管托管业务。张先生自2010年3月起任本行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月任本行行长助理、党委委员,期间,2006年4月至2007年3月兼任总行公司银行部总经理。张先生2000年1月至2006年4月任本行总行营业部副总经理、常务副总经理和总经理;1990年9月至2000年1月先后在总行信贷部、济南分行和青岛分行工作,曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自1990年9月至今,张先生一直为本行服务,在中国银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级管理人员,先后于中南财经大学(现中南财经政法大学)、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生,现任中信银行资产托管部总经理,硕士研究生学历,高级经济师,教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行,相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长,总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、资产管理部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长,总行行政管理部总经理。

三、基金托管业务经营情况

2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2017年半年末,中信银行已托管136只公开募集证券投资基金,以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODII等其他托管资产,托管总规模达到741.71亿元人民币。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1.直销机构:

| | | |
|----------------------|--------------------------------------|--|
| (1) 嘉实基金管理有限公司直销中心 | | |
| 办公地址 | 北京市东城区建国门内大街7号万安中心D座1222 | |
| 电话 | (010) 162215688 传真 (010) 162215677 | |
| 联系人 | 赵旭 | |
| (2) 嘉实基金管理有限公司上海直销中心 | | |
| 办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期33层09-11单元 | |
| 电话 | (021) 38758668 传真 (021) 68880023 | |
| 联系人 | 邵桐 | |
| (3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司 | | |
| 办公地址 | 成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座2单元2110A-06单元 | |
| 电话 | (028) 186202100 传真 (028) 186202100 | |
| 联系人 | 王玥明 | |
| (4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司 | | |
| 办公地址 | 深圳市福田区益田路5001号平安金融大厦1602 | |
| 电话 | (0755) 184362200 传真 (0755) 226870663 | |
| 联系人 | 熊静雯 | |
| (5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司 | | |
| 办公地址 | 青岛市市南区江苏路9号华润大厦1301室 | |
| 电话 | (0632) 16677997 传真 (0632) 16677676 | |
| 联系人 | 胡洪峰 | |
| (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司 | | |
| 办公地址 | 杭州市下城区新市街恒昌大厦1206号万象城国际1001A室 | |
| 电话 | (0571) 88861332 传真 (0571) 88821281 | |
| 联系人 | 王璐 | |
| (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司 | | |
| 办公地址 | 福州市鼓楼区五四路137号恒裕国际1001A单元 | |
| 电话 | 0591-88013670 传真 0591-88013670 | |
| 联系人 | 吴志峰 | |
| (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司 | | |

| | |
|------|------------------------------------|
| 办公地址 | 南京市白下区中山东路288号新世际广场6楼4202室 |
| 电话 | (025) 166671110 传真 (025) 166671100 |
| 联系人 | 徐彩娟 |

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司

| | |
|------|-------------------------------------|
| 办公地址 | 广州市天河区珠江新城6号广州国际金融中心5605单元 |
| 电话 | (020) 1888322125 传真 (020) 181562120 |
| 联系人 | 周倩 |

2、代销机构:

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构:

| | |
|-------|---------------------------------------|
| 名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 住所 | 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期33层09-11单元 |
| 办公地址 | 北京市建国门北大街8号华润大厦A座 |
| 法定代表人 | 杨红瑞 |
| 联系人 | 孙鑫 |
| 电话 | (010) 162215688 |
| 传真 | (010) 165185678 |

(三)出具法律意见书的律师事务所

| | |
|---------|---------------------------------------|
| 名称 | 上海市锦泰律师事务所 |
| 住所、办公地址 | 上海市浦东新区世纪大道26号华夏银行大厦14楼 |
| 负责人 | 廖海 |
| 电话 | (021) 151150288-885 传真 (021) 51150388 |
| 经办律师 | 刘佳、张兰 |

(四)审计基金财产的会计师事务所

| | |
|---------|------------------------------------|
| 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号星展银行大厦6楼 |
| 办公地址 | 上海市黄浦区西藏路202号安联大厦26楼普华永道中国11楼 |
| 法定代表人 | 李丹 |
| 电话 | (021) 123228888 传真 (021) 123228800 |
| 经办注册会计师 | 李峰、陈佳 |

四、基金的名称

本基金名称:嘉实活钱钱包货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式
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。

七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许基金投资的金融工具,包括现金;期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;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;以及中国证监会、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。

法律法规或监管机构允许基金投资其他金融工具,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,并且法律法规允许货币市场基金投资货币市场基金,本基金可参与其他货币市场基金的投资,不需召开持有人大会。

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

1、资产配置策略
根据宏观经济指标(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业水平、国际市场利率水平、汇率等),决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布。
根据各类资产的流动性特征(主要包括:平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量等),决定组合中各类资产的投资比例。

2、个券选择策略
在个券选择上,本基金通过定性定量方法,综合分析收益率曲线、流动性、信用风险,评估个券投资价值,发掘具备相对价值的个券。

3、银行存款投资策略
本基金根据不同银行的银行存款收益率情况,结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析,以及对整体利率市场环境及其变动趋势的研究,在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。

4、利用短期市场机会的灵活策略
由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期市场失衡;新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的原因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

5、投资决策

(1) 决策依据
① 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
② 宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行状况,货币市场和证券市场运行状况;
③ 分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。
(2) 决策程序
① 投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和市场的判断决定基金的投资策略、审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
② 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析,提出分析报告。
③ 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究部门提出的报告,并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定具体资产配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。
④ 交易部门依据基金投资的指令,制定交易策略并执行交易。
⑤ 监察稽核部门负责监控基金的投资管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定,风险管理部门运用本风险监控模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险进行风险测算,对基金组合的风险进行评估,提交风险监控报告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款税后利率
活期存款是具备最高流动性的存款,本基金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日在中国证监会指定媒体上刊登公告,而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,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。

十一、基金投资组合报告

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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月17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截至2017年6月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

本基金投资于证券市场，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。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年7月17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截至2017年6月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

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 | 固定收益投资 | 1,080,401,661.69 | 36.35 |
| 其中:债券 | 1,080,401,661.69 | 36.35 | |
| 资产支持证券 | | | |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,174,152,081.23 | 21.85 |
| 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 | 2,193,075,807.77 | 40.02 |
| 4 | 其他资产 | 26,317,430.01 | 0.49 |
| 5 | 合计 | 5,374,947,989.70 | 100.00 |

2. 报告期末债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|--|--------------|---------------|---------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 1.96 | |
| 2 | 其中:买断式回购融资 | - | |
| 序号 <th>项目</th> <th>金额(元)</th> <th>占基金资产净值的比例(%)</th> | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 59,779,801.11 | 1.13 |
| 3 | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为期报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2)报告期内本基金每日债券回购的资金余额均未超过资产净值的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 | 46 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 39 |

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过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 | 各期限资产净值占基金资产净值比例(%) | 各期限负债占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------------------|---------------------|-------------------|
| 1 | 30天以内 | 50.10 | 1.13 |
| 2 | 其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 30天(含)-60天 | 16.27 | - |
| 4 | 其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 60天(含)-90天 | 26.65 | - |
| 6 | 其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 7 | 90天(含)-120天 | 7.57 | - |
| 8 | 其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 9 | 120天(含)-397天(含) | - | - |
| 10 | 其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 100.00 | 1.13 |

4. 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过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 | 国债债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 300,280,274.81 | 5.65 |
| 4 | 政策性金融债 | 300,280,274.81 | 5.65 |
| 5 | 企业短期融资券 | 179,929,796.30 | 3.39 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,500,211,590.58 | 28.24 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,980,401,661.69 | 37.28 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

注:上表,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应计利息。

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