

招商招福宝货币市场基金招募说明书 更新 摘要

(2018年第1号)

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
截止日:2017年12月13日

重要提示
招商招福宝货币市场基金(以下简称“本基金”)根据2015年12月14日中国证监会《关于准予招商招福宝货币市场基金注册的批复》(证监许可[2015]12928号)和2017年5月18日中国证监会证券投资基金监管部《关于招商招福宝货币市场基金延期募集备案的回函》(机构部函[2017]12328号)进行募集。本基金的基金合同于2017年6月13日正式生效。本基金为契约型开放式。

招商基金管理有限公司(以下称“本基金管理人”或“管理人”)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,中国证监会对基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础,以充分的信息披露和投资者适当性为核心,以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。投资者应认真阅读招募说明书、基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

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,基金管理人不对货币市场基金本金一一定利,也不保证最低收益。

投资有风险,过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的成绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在认购(或申购)本基金时应认真阅读本《招募说明书》。

基金《招募说明书》自《基金合同》生效日起,每六个月更新一次,并于每六个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每六个月的最后一日。

本更新招募说明书所载内容截止为2017年12月13日,有关财务和业绩表现数据截止日为2017年9月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中信银行股份有限公司已于2017年12月27日复核了本次更新的招募说明书。

§1 基金管理人

1.1 基金管理人概况

名称:招商基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李浩
成立时间:1993年4月20日
组织形式:股份有限公司
注册资本:4.89.35亿元人民币
存续期间:持续经营
批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
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:010-85203204
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

经营范围:吸收存款;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;汇兑、外汇业务;代理开放式基金业务;提供基金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者货币业务;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08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,0998.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,是中国最早参与国内金融市场竞争的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外,于2005年8月,正式更名为“中信银行”。2006年12月,以中国工商银行和中国国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行控股有限公司。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,中信银行成功收购国际金融控股有限公司(简称“中银国际”)70.32%股权。经过三十年的发展,中信银行已成为国际资本实力最强、市值领先的商业银行之一。是一家快速增长并拥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。

基金经理:管理时间:2015年4月8日至今)、招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理:管理时间:2015年6月9日至今)、招商招盈18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理:管理时间:2016年6月1日至至今)、招商招富宝交易型货币市场基金基金经理(管理时间:2016年6月30日至至今)、招商中国信用机会定期开放债券型证券投资基金(QDII)基金经理:管理时间:2016年9月2日至至今)、招商招轩纯债债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2016年10月26日至至今)、招商招裕6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2016年12月23日至至今)、招商沪港深科技自主创新主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年4月26日至至今)、招商招福宝货币市场基金基金经理(管理时间:2017年6月13日至至今)、招商招财通理财债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2017年6月19日至至今)。

1.2.5 投资决策委员会成员

公司的投资决策委员会由如下成员组成:总经理金旭、副总经理沙晓、副总经理杨渺、总经理助理兼量化投资部负责人吴昊峰、总经理助理兼固定收益投资部负责人裴晓辉、交易部总监路明、国际业务部总监白海峰。

1.2.6 上述人员之间均不存在近亲属关系。

§2 基金托管人

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12大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门12大街9号
法定代表人:李庆平
成立时间:1987年4月20日
组织形式:股份有限公司
注册资本:4.89.35亿元人民币
存续期间:持续经营
批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅函[1987]14号
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:010-85203204
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

经营范围:吸收存款;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;汇兑、外汇业务;代理开放式基金业务;提供基金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者货币业务;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08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,0998.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,是中国最早参与国内金融市场竞争的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外,于2005年8月,正式更名为“中信银行”。2006年12月,以中国工商银行和中国国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行控股有限公司。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,中信银行成功收购国际金融控股有限公司(简称“中银国际”)70.32%股权。经过三十年的发展,中信银行已成为国际资本实力最强、市值领先的商业银行之一。是一家快速增长并拥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。

2.2 主要人员情况
孙晓刚先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起担任本行行长。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月起担任本行执行董事;2011年12月至2014年5月任本行副行长;2011年10月起任本行党委副书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总裁兼副行长;2010年1月起担任本行执行董事;2008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支行、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月任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。

张先生,中信银行执行长、分管托管业务。张先生自2010年3月起担任本行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月担任本行执行董事、党委委员。期间,2006年4月至2007年3月曾兼任本行总行银行卡部总经理。张先生2008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月先后在本行北京、南京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。张先生为高级经济师,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,教授级注册税务师。先后毕业于四川大学和中国人民大学工商管理学院。曾供职于中国民生银行四川省分行,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理财市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长,总行行政管理部总经理。

2.3 基金业务经营情况
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年三季度末,中信银行已托管142只公募基金证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模达到7.59万亿元人民币。

§3 相关服务机构

3.1 直销机构

直销机构:招商基金管理有限公司
招商基金客户服务中心电话:400-887-9555(免长途话费)
招商基金官网交易平台
交易网站:www.cmfcchina.com
客服电话:400-887-9555(免长途话费)
电话:(0755)83196437
传真:(0755)83199059
联系人:陈辉
招商基金战略客户部
地址:上海市西城区月坛南街1号院3号楼1801
电话:13718159609
联系人:袁然
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南塔15楼
电话:(021)38577388
联系人:胡智强
招商基金机构理财部
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23楼
电话:(0755)83190452
联系人:刘刚
地址:上海市西城区月坛南街1号院3号楼1801
电话:18600128666
联系人:裴晓辉
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南塔15楼
电话:(021)38577379
联系人:伊泽源
招商基金直销交易客户服务方式
地址:深圳市南山区科苑路科兴科学园A3单元3楼招商基金客服中心直销柜台
电话:(0755)83196359 83196358
传真:(0755)83196360
备用传真:(0755)83199266
联系人:冯敏

3.2 代销机构

代销机构:招商基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1000号
法定代表人:李浩
电话:(021)22800000
传真:(021)22800034
联系人:汪静
客户服务热线:95558
网址:www.cmfchina.com

基金管理人可根据有关法律法规规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

3.2 注册登记机构
名称:招商基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李浩
电话:(0755)83196445
传真:(0755)83196436
联系人:宋宇彬

3.3 律师事务所和经办律师
名称:上海源泰律师事务所
住所地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
法定代表人:黄卫
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:刘佳、张雯倩
联系人:刘佳

3.4 会计师事务所和经办注册会计师
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东长安街1号东方广场东2办公楼八层
法定代表人:邵俊
电话:(0755)2547 1000
传真:(0755)8266 8930
经办注册会计师:程海良、吴钟鸣
联系人:蔡卫江

招商招福宝货币市场基金

货币市场基金

6.1 基金类别
本基金根据投资者认购、申购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费,因此形成不同的基金类别。本基金将设立A类和B类两类基金份额,两类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。

6.2 基金份额类别的限制

本基金根据投资者认购、申购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费,因此形成不同的基金类别。本基金将设立A类和B类两类基金份额,两类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。

6.3 基金份额的申购与赎回

1.本基金A类、B类基金份额不进行自动份额类别调整。当A类基金份额持有人的基金份额持有余额达到或超过500万份时,须自行申请A类基金份额至B类基金份额之间的互相

转换业务。今后开通本基金A类、B类基金份额自动份额类别调整业务时,本公司将另行公告。

2.投资者认购、申购及基金份额类别转换申请确认后,实际获得的基金份额等级以本基金的登记机构根据上述规则确认的基金份额类别为准。

6.4 基金份额类别及规则的调整
在法律法规和基金合同规定的范围内,以及对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,本基金可以:

1.根据基金实际情况,在履行适当程序后,基金管理人停止某类基金份额的销售、调整基金份额类别等,上述调整实施前不需召开基金份额持有人大会,但基金管理人需依照《信息披露办法》的有关规定及时公告。

2.基金管理人可以与基金托管人协商一致并在履行相关程序后,调整认(申)购各类基金份额的最低金额限制及互相转换规则,基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

3.根据基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人可开通本基金A类、B类基金份额自动份额类别调整业务并公告。

§7 投资目标

在兼顾基金资产的安全性和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

§8 投资范围

本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的金融工具,包括:现金,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,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,及中国证监会、中国人民银行认可的其它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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

§9 投资策略

本基金以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对短期金融工具的组合操作,在保证本金的安全性与资产流动性的同时,追求稳定的当期收益。

●根据宏观经济指标、货币市场利率,确定组合平均剩余到期期限;
●根据各期限品种的流动性、收益性以及信用水平来确定组合资产配置;
●根据各期限品种流动性对组合平均剩余到期期限及投资品种比例进行适当调整;
●在保证投资组合流动性的前提下,利用现代金融分析方法和工具,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会。

●合理有效配置基金的现金流,保持本基金资产的流动性。
1.本基金主要投资策略的制定将依据以下投资方法和技术
(1)收益率曲线研究

短期资金市场同货币市场紧密相关,连接两个市场的分析工具是收益率曲线。本基金将根据货币市场利率变化以及隐含的短期收益率和远期利率提供的价值判断基础,为各种投资策略的制定提供决策依据。

(2)短期资金市场的资金供给与需求研究
短期资金市场资金成本的反映。短期货币资金供应与需求决定了短期利率水平。

(3)企业信用分析
直接融资的发展是一个长期趋势,企业债、企业短期融资券因此也将成为货币市场基金重要的投资对象。为了保证基金资产的安全,本基金将按照相关法律法规仅投资于具有满足信用等级要求的企业债、短期融资券。与此同时,本基金还将深入分析发行人的财务稳健性,判断发行人违约的可能性,严格控制企业债、短期融资券的违约风险。

银行间市场与交易所市场在资金供给者和需求者结构上均存在差异,利率水平因此也有所不同。不同类型市场工具由于存在税负、流动性、信用风险上的差异,其收益率水平也略有不同。资金供给者、需求者结构的变化也会引起利率水平的变化。积极利用这些利率差异,利率变化具体可在保证流动性、安全性的基础上为基金资产带来更高的收益率。

2.2 本基金具体操作策略
(1)滚动配置策略
本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益率与市场利率的基本一致。

(2)久期投资策略
本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。

(3)套利策略
套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金自身流动性、安全性和操作性的基础上寻求更高的收益率。

4.4 资产配置策略
股票、债券发行以及年末决算等因素可能会导致市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高市场利率。充分利用这种失衡就能提高基金资产的收益率。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,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。

§10 投资决策和投资程序

1.投资决策依据
(1)国家有关法律、法规和基金合同有关规定;
(2)国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响;
(3)国家货币政策及债券市场政策;
(4)商业银行的信贷政策。

2.投资决策机制
本基金实行投资决策委员会制,强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究成果整合,设立了投资研究部,策略分析师、固定收益分析师、数量分析师和基金基金经理,充分发挥主观能动性,渗透到投资决策的关键环节,群策群力,为基金份额持有人谋取中长期稳定的较高投资回报。

3.投资决策程序
本基金具体的投资决策机制与流程为:
(1)宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向,提交策略报告;
(2)债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告;

(3)信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。
(4)数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。
(5)在分析研究报告的基础上,基金经理提出月度投资组合计划并提交投资决策委员会审议。

(6)投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。
(7)如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。

(8)集中交易室执行交易指令。

§11 业绩比较基准

人民币活期存款基准利率(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,因此采用人民币活期存款基准利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生变化,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。如果今后法律法规发生变化,或中国人民银行调整或修正该基准利率的发布,或者市场中出现其他更具代表性更强、更科学客观的业绩比较基准更适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金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,而无需召开基金份额持有人大会。

§12 风险收益特征

本基金为货币市场基金,是证券市场中的低风险品种。本基金的风险收益特征略低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

§13 投资组合报告

招商招福宝货币市场基金管理人:招商基金管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至2017年9月30日,来源于《招商招福宝货币市场基金2017年第3季度报告》。

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 3,663,817,722.21 32.87
其中:国债 3,663,817,722.21 32.87

资产支持证券 3,103,487,406.22 27.84
其中:资产支持证券 3,103,487,406.22 27.84

2 银行存款和结算备付金合计 4,240,560,918.20 38.07
其中:银行存款 30,165,216.61 0.27

3 合计 11,147,021,382.27 100.00

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 7.94
其中:交易所债券回购 0.96

序号 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 1,000,989,000.50 9.06
其中:交易所债券回购 0.96

注: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
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3 基金投资组合平均剩余期限
3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

报告期末投资组合平均剩余期限 天数

1 报告期内投资组合平均剩余期限 1103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值 108

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 47
其中:报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的债券 0.96

4 报告期内投资组合平均剩余期限超过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期限未超过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 79,842,613.87 0.79
2 央行票据 918,845,327.68 9.07

其中:政策性金融债 918,845,327.68 9.07
4 企业债 0.00 0.00

5 企业短期融资券 0.00 0.00
6 中期票据 2,685,129,702.60 26.20

7 资产支持证券 3,103,487,406.22 30.31
8 债券回购 1,000,989,000.50 9.86

9 合计 3,663,817,722.21 36.13
10 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的债券 0.96

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 债券余额(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 11719203 17国债附息0203 10,000,000 989,569,806.10 9.76
2 117198274 17国债附息0206 4,000,000 395,642,628.77 3.90

3 117198297 17国债附息0202 4,000,000 395,642,628.77 3.90
4 11719286 17国债附息0206 3,000,000 297,476,931.87 2.93

5 11718547 17光大银行CD186 2,000,000 196,666,640.46 1.93
6 117185624 17光大银行CD186 2,000,000 196,666,640.46 1.93

7 117185617 17光大银行CD186 2,000,000 196,666,640.46 1.93
8 170001 17国债01 1,800,000 179,289,903.81 1.77

9 170004 17国债04 1,800,000 179,441,912.34 1.77
10 170410 17国债10 1,800,000 179,441,912.34 1.77

7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

序号 偏离情况 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在0.25%~0.5%间的次数 0
报告期内偏离度的最高值 0.03%

报告期内偏离度的最低值 -0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.02%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%的情况未发生。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%的情况未发生。

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。
9 投资组合报告附注

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

9.2 报告期内负偏离度的前十名证券投资
证券代码11780297(证券代码11780297)、17贵阳银行CD085(证券代码11780274)、17天津农村商业银行CD227(证券代码11785624)外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.17东莞银行CD052(证券代码11780297)
该证券发行于2017年6月23日,2017年3月24日分别因违规经营,被东莞银监局罚。

2.17贵阳银行CD085(证券代码11780274)
该证券发行于2017年6月23日,2017年4月24日分别因违规经营,被央行贵阳中心支行处罚。

3.17天津农村商业银行CD227(证券代码11785624)
该证券发行于2017年5月26日因违规经营,被天津银监局罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

9.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存在担保资金 0.00
2 应收证券清算款 0.00

3 应收利息 30,165,216.61
4 应收申购款 0.00

5 其他应收款 0.00
6 待摊费用 0.00

7 其他 0.00
8 合计 30,165,216.61

§14 基金的