



# Disclosure 信息披露

2018年1月13日 星期六  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

# B110

## (上接 B109版)

联系人:张茹  
客服电话:400-820-2819  
网址:www.fundbundrade.com  
(4)北京微动利投资管理有限公司  
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼  
341室  
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼  
341室  
法定代表人:梁洪军  
联系人:李长军  
电话:010-52609656  
传真:010-51957430  
网址:http://www.buyufoyou.com/  
客服电话:400-819-6665  
(6)上海煜煜基金销售有限公司  
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)  
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室  
法定代表人:王翔  
联系人:蓝杰  
电话:021-65370077  
传真:021-55085991  
客户服务电话:021-65370077  
网址:www.yjyfund.com  
(65)深圳前海鑫泰基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场B座211室  
法定代表人:吴永宏  
联系人:蓝海英  
电话:0755-66607751  
网址:http://zq.11747.atobo.com.cn  
(66)上海中正达广投资管理有限公司  
注册地址:上海市虹口区东大名路789号15楼302室  
办公地址:上海市徐汇区龙漕路2815号302室  
法定代表人:黄欣  
联系人:戴晓霞  
电话:021-33768132  
客服电话:400-6767-523  
网址:www.zzwealth.cn  
(67)北京红点基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室  
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室  
法定代表人:牛亚楠  
联系人:李亚楠  
联系电话:18610887109  
客服电话:400-060-8876  
网址:www.jmbbox.com  
(68)深圳富利财富管理有限公司  
注册地址:深圳市福田区深南中路2号鹏润大厦A座201室  
办公地址:深圳市福田区深南中路2号鹏润大厦A座201室  
法定代表人:李悦  
联系人:曹晨晨  
客服电话:010-85932450  
网址:www.igisafe.com  
客服电话:400-066-8586  
(47)北京增财基金销售有限公司  
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室  
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室  
法定代表人:李煜  
联系人:李煜  
联系电话:13521165454  
客服电话:400-001-8811  
传真:010-67000988-6000  
网址:www.zcw.com.cn  
(6)北京元璟泽基投资管理有限公司  
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室  
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层  
法定代表人:李悦  
联系人:张琳  
电话:010-88545312  
网址:www.chtfund.com  
客服电话:400-8980-618  
(49)北京汇成基金销售有限公司  
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108  
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108  
联系人:丁亚楠  
电话:010-56282140  
网址:http://www.fundzone.cn  
(50)深圳盈米基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦A座1-A  
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山119101-03A-1  
法定代表人:苗晋安  
联系人:苗晋安  
客服电话:4007-903-688  
(51)北京晟天天下投资管理有限公司  
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村745号03室  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21A28层  
法定代表人:蒋煜  
联系人:殷安  
电话:010-58170844  
传真:010-58170710  
网址:www.abengshiview.com.cn  
客服电话:400-818-8866  
(52)一路财富(北京)信息科技有限公司  
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五楼大悦中心C座702室  
办公地址:北京市西城区阜成门内大街2号万通新世界广场A座2208  
法定代表人:吴昊秀  
联系人:刘栋栋  
电话:010-88312877  
传真:010-88312099  
客服电话:400-001-1566  
网址:www.yilucaifu.com  
(53)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丹棱soho10层  
办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层  
法定代表人:赵荣春  
联系人:高静娴  
电话:010-57418813  
传真:010-57569671  
网址:www.qianjing.com  
客服电话:400-893-6885  
(54)北京唐鼎耀华投资有限公司  
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融中心38层  
法定代表人:张冠宇  
联系人:刘美鑫  
客服电话:010-85870662  
传真:010-59200800  
网址:www.datangwealth.com  
客服电话:400-819-9858  
(55)天津国富基金销售有限公司  
注册地址:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室  
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层  
法定代表人:丁东亮  
联系人:郭宝亮  
电话:010-59287984  
传真:010-59287824  
客服电话:400-111-0889  
(56)中经北证(北京)资产管理有限公司  
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号  
办公地址:北京市西城区车庄大街4号  
法定代表人:徐福慧  
联系人:陈娜  
电话:010-68292940  
传真:010-68292914  
客服电话:400-604-0030  
网址:www.fundfcm.com  
(57)上海万得基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座  
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼  
法定代表人:王廷富  
电话:010-52098878  
传真:010-52098784  
客服电话:400-111-0889  
(58)中经北证(北京)资产管理有限公司  
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号  
办公地址:北京市西城区车庄大街4号  
法定代表人:徐福慧  
联系人:陈娜  
电话:010-68292940  
传真:010-68292914  
客服电话:400-604-0030  
网址:www.fundfcm.com  
(57)上海万得基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座  
办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼  
法定代表人:王廷富  
电话:010-52098878  
传真:010-52098784  
客服电话:400-111-0889  
(58)凤凰基金(银川)投资管理有限公司  
注册地址:宁夏银川市金凤区凤凰湾中央商务区万寿路142号1402  
办公地址:北京市朝阳区景泰路18号院18号楼  
法定代表人:程刚  
联系人:张旭  
电话:010-58160168  
传真:010-5810-5919  
网址:www.fengfund.com  
(59)扬州国信嘉利投资管理有限公司  
注册地址:江苏省扬州市文昌西路56号元国际320  
办公地址:江苏省扬州市文昌西路56号元国际320  
法定代表人:王浩  
网址:www.gjplm.com  
客服电话:400-021-6088  
(60)上海联泰资产管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室  
办公地址:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座2楼  
法定代表人:燕斌  
联系人:陈东  
电话:021-52822063-8301  
传真:021-62990063  
客服电话:4000-466-788  
网址:www.4000-466-788  
(61)珠海盈米基金销售有限公司  
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝华路6号  
办公地址:广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼  
法定代表人:肖雯  
联系人:吴昊浩  
电话:020-89629011  
传真:020-89629011  
客服电话:020-89629066  
网址:www.yingmi.com  
(72)和耕传承基金销售有限公司  
注册地址:郑州市郑东新区东风南路康宁互联网金融大厦9层  
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁互联网金融大厦9层  
法定代表人:李淑慧  
联系人:方良志  
电话:0371-55213196  
传真:0371-55215671  
网址:http://www.hggcsp.com  
(63)为丰金融服务(深圳)有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦1115、1116及1307室  
法定代表人:TANYIKUWAN  
联系人:谭晶晶  
电话:0755-89460500  
传真:0755-21674453  
客服电话:400-684-0500  
网址:www.afstps.com  
(74)深圳市小牛投资咨询有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市福田区彩田路2009号瀚森大厦17楼  
法定代表人:黄俊杰  
联系人:秦晓杰  
电话:0755-32819999  
客服电话:400-669-5666  
网址:www.neoo6.com.cn  
(75)北京懒猫金融信息服务有限公司  
注册地址:北京市石景山区石景山路31号院3号楼骏景国际广场A座1119  
办公地址:北京市朝阳区四惠东惠通惠河产业园二期1111号  
法定代表人:许良臣  
联系人:朱翔宇  
联系电话:15921710500  
网址:www.lanmao.com  
客服电话:400-500-882  
(76)京东金融—北京肯特瑞财富投资管理有限公司  
注册地址:北京市海淀区海淀大街三街2号4层401-15  
办公地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15  
法定代表人:程超  
联系人:赵海超  
电话:4000888816  
客服电话:951518  
网址:fund.jd.com  
(77)上海云湾投资管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
法定代表人:戴新装  
联系人:江辉  
电话:021-20530224  
传真:021-20538999  
客服电话:400-820-1515  
网址:www.zhengzhongfund.com  
(78)深圳市金斧子投资管理有限公司  
注册地址:深圳市南山区智慧广场A栋11层1101-02  
办公地址:深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼  
法定代表人:陈婉莹  
联系人:陈奕璇  
电话:010-400950888  
网址:www.jfzinv.com  
客服电话:4009508888  
(79)北京蛋卷基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
法定代表人:钟奕雯  
客服电话:400-061-8518  
网址:https://danjuanapp.com  
(80)深圳市华融金融服务有限公司  
注册地址:深圳市福田区福田街道滨河路5022号联合广场A座裙楼  
办公地址:深圳市福田区联合广场A座裙楼A302  
法定代表人:喻天竹  
联系人:万力  
电话:0755-83190388  
传真:0755-82945664  
网址:www.brjtm.com  
客服电话:400-600-0583  
(81)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A  
法人代表:廖泽峰  
联系人:廖泽峰  
联系电话:0755-83655588  
客服电话:0755-83655588  
(82)上海凯恩斯基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区东大名路701号凯恩斯大厦3F  
办公地址:上海市虹口区东大名路701号凯恩斯大厦3F  
法定代表人:李海  
联系人:李海  
电话:021-60833900  
网址:www.amcfund.com  
客服电话:400-817-5666  
(83)深圳盈信基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦A座1-A  
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山119101-03A-1  
法定代表人:苗晋安  
联系人:苗晋安  
网站:www.fundmying.com  
客服电话:4007-903-688  
(84)深圳信诚基金销售有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋210室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市南山区时代财富大厦第49A单元  
联系人:曹晨晨(执业证号:1110200110651368)  
电话:0755-82786863  
E-mail:service@cepfund.com  
网址:http://www.cepfund.com  
(二)基金注册登记机构  
名称:平安大华基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层  
办公地址:深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层  
法定代表人:罗春凤  
电话:0755-22990888  
传真:0755-23990088  
联系人:张平  
(三)律师事务所和经办律师  
律师事务所:北京市京伦律师事务所  
地址:北京市海淀区中关村南大街17号韦时时代中心D座1910  
负责人:曹晓(执业证号:1110200110651368)  
电话:010-68938188  
传真:010-88578761  
经办律师:杨晓勇(执业证号:11101200210185600)  
师红宇(执业证号:1110120101622926)  
联系人:杨晓勇(执业证号:11101200210185600)  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼  
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼  
法定代表人:李丹  
电话:(021)23238888  
传真:(021)23238800  
联系人:边晓红  
经办注册会计师:曹翠丽、边晓红

### 四、基金的名称

### 五、基金的类型

### 六、基金的运作方式

### 七、基金的投资

(一)投资目标  
在严格控制基金资产配置风险和保持基金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。

(二)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,包括现金,期限一年以内(含一年)的银行存款、同业存单,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,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、中国国债、中国央行发行的其他具有良好流动性的货币市场工具。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三)投资策略  
本基金根据对未来短期利率变动的预测,确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析,确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的当期收益。

1. 整体资产配置策略  
本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、短期资金市场状况等因素的分析,综合判断未来短期利率变动,对投资组合的平均剩余期限进行控制。

(1)利率预期策略  
通过对通货膨胀、GDP、货币供应量、国际利率水平、金融监管政策取向跟踪分析,形成对基本面的宏观判断。同时,结合微观层面研究,主要考察指标包括:央行公开市场操作、主要机构投资者对短期债券预期、债券回购利率变化、合理预期短期利率利率曲线变化。

(2)动态调整投资组合平均剩余期限  
根据利率预期分析,动态调整并控制投资组合平均剩余期限在120天以内,当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值波动风险;当市场看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。

2. 类属资产配置策略  
类属资产配置投资组合在各类投资品种如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种之间的配置比例,作为现管理工具本基金将根据各类投资品种的流动性、收益性和风险特征,利用定性分析和定量分析方法,决定参与的投资品种和各类投资品种的配置比例及投资品种期限结构。

(1)流动性分析  
本基金在确定投资组合平均剩余期限的变化进行动态分析,确定本基金的流动性目标。在此基础上,基金管理人将在高流动性资产和相对流动性较差资产间寻找平衡,以满足组合的日常流动性需求。

(2)收益-风险分析  
通过分析各类投资品种的相对收益、利差变化、市场容量、信用等级情况、流动性风险、信用风险等因素来确定配置比例和期限组合,寻找有投资价值的投资品种,增持相对低估、价格将上升,能给组合带来相对较高回报的类属;减持相对高估、价格将下降,给组合带来相对较低回报的类属,借以取得较高的总回报。

3. 债券选择策略  
在个券选择层面,本基金将首先从安全性角度出发,优先选择利率、短期国债等信用等级较高的债券品种以规避信用违约风险。对于信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券,本基金也可以进行投资。除考虑安全性因素外,在具体债券选择上,基金管理人将遵循以下原则:  
(1)根据细资产的平均剩余期限、资信等级、流动性指标(流通总量、日均交易量),决定是否纳入组合。  
(2)根据个债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比,对照基金的收益要求,决定是否纳入组合。

(3)根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间),决定投资总量。

(4)若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券价格出现低估,本基金将对此类低估品种进行重点关注。

4. 流动性管理策略  
(74)深圳市小牛投资咨询有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳前海商务秘书有限公司)  
办公地址:深圳市福田区彩田路2009号瀚森大厦17楼  
法定代表人:黄俊杰  
联系人:秦晓杰  
电话:0755-32819999  
客服电话:400-669-5666  
网址:www.neoo6.com.cn  
(75)北京懒猫金融信息服务有限公司  
注册地址:北京市石景山区石景山路31号院3号楼骏景国际广场A座1119  
办公地址:北京市朝阳区四惠东惠通惠河产业园二期1111号  
法定代表人:许良臣  
联系人:朱翔宇  
联系电话:15921710500  
网址:www.lanmao.com  
客服电话:400-500-882  
(76)京东金融—北京肯特瑞财富投资管理有限公司  
注册地址:北京市海淀区海淀大街三街2号4层401-15  
办公地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15  
法定代表人:程超  
联系人:赵海超  
电话:4000888816  
客服电话:951518  
网址:fund.jd.com  
(77)上海云湾投资管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
法定代表人:戴新装  
联系人:江辉  
电话:021-20530224  
传真:021-20538999  
客服电话:400-820-1515  
网址:www.zhengzhongfund.com  
(78)深圳市金斧子投资管理有限公司  
注册地址:深圳市南山区智慧广场A栋11层1101-02  
办公地址:深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼  
法定代表人:陈婉莹  
联系人:陈奕璇  
电话:010-400950888  
网址:www.jfzinv.com  
客服电话:4009508888  
(79)北京蛋卷基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
法定代表人:钟奕雯  
客服电话:400-061-8518  
网址:https://danjuanapp.com  
(80)深圳市华融金融服务有限公司  
注册地址:深圳市福田区福田街道滨河路5022号联合广场A座裙楼  
办公地址:深圳市福田区联合广场A座裙楼A302  
法定代表人:喻天竹  
联系人:万力  
电话:0755-83190388  
传真:0755-82945664  
网址:www.brjtm.com  
客服电话:400-600-0583  
(81)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A  
法人代表:廖泽峰  
联系人:廖泽峰  
联系电话:0755-83655588  
客服电话:0755-83655588  
(82)上海凯恩斯基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区东大名路701号凯恩斯大厦3F  
办公地址:上海市虹口区东大名路701号凯恩斯大厦3F  
法定代表人:李海  
联系人:李海  
电话:021-60833900  
网址:www.amcfund.com  
客服电话:400-817-5666  
(83)深圳盈信基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦A座1-A  
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山119101-03A-1  
法定代表人:苗晋安  
联系人:苗晋安  
网站:www.fundmying.com  
客服电话:4007-903-688  
(84)深圳信诚基金销售有限公司

(8)除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外,债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%;

(9)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得高于30%;

(10)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%;

(11)到期日在10个交易日以上的逆回购,银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%;

(12)在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(13)中国证监会规定的其他比例限制。

除上述第(9)条外,因规模或其他市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的,基金管理人应在10个交易日调整完毕,以达到上述标准,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

3、本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级,且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。

本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的,基金管理人应在评级报告发布之日起3个月内对其予以全部卖出。

4、若法律法规或中国证监会的相关规定要求发生变更,基金管理人履行适当程序后,本基金可相应调整投资策略限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。基金运作期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

(八)禁止行为  
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

1. 承销证券;
2. 违反规定向他人贷款或提供担保;
3. 从事承担无限责任的投资;
4. 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
5. 向基金管理人、基金托管人出资;
6. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
7. 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合国务院证券监督管理机构的规定,并履行信息披露义务。

(九)投资组合平均剩余期限的计算

1. 计算公式  
本基金按下列公式计算平均剩余期限:  
(Σ投资于金融工具产生的资产×剩余期限-Σ投资于金融工具产生的负债×剩余期限+债券正回购×剩余期限)/(投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+债券正回购)

2. 本基金按下列公式计算平均剩余存续期限:  
(Σ投资于金融工具产生的资产×剩余存续期限-Σ投资于金融工具产生的负债×剩余存续期限+债券正回购×剩余存续期限)/(投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+债券正回购)

3. 各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定  
(1) 银行活期存款,清算备付金,交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天; 证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;

(2) 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算; 买断式回购债券的剩余期限和剩余存续期限以该基础债券的剩余期限,待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;

(3) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算; 有存款期限,根据协议可提前支取且没有利息损失的理财产品,剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算; 银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以协议约定的通知天数计算;

(4) 中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算;

(5) 组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外:  
① 允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。  
② 允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

(十)基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

2. 有利于基金财产的安全与增值;

3. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的人谋取利益;

(十一)基金的投资、融券  
本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(十二)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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,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9月30日,本财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	30,511,363,775.04	29.26
2	债券正回购	30,056,030,072.38	29.42
3	买入返售金融资产	454,400,702.66	0.44
4	应收利息	7,268,172,283.37	7.39
5	银行存款和拆入金融资产合计	65,374,555,863.36	62.69
6	其他资产	685,607,490.39	0.67
7	负债	104,280,699,414.16	100.00

  

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.08
其中:买断式回购融资	-	-	-

  

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	报告期内债券期末余额融资余额	995,19,947.20	0.06
其中:买断式回购融资	-	-	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的高单平均值。

债券正回购的资金余额占基金资产净值的20%的说明  
在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

### 1.3.3.投资组合平均剩余期限基本情况

项目	次数
报告期内投资组合平均剩余期限超过120天	97
报告期内投资组合平均剩余期限超过180天	100
报告期内投资组合平均剩余期限超过240天	68

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明  
本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

### 1.3.4.投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金总资产的比例(%)	各期限负债占基金总资产的比例(%)
1	30天以内	11.21	0.06
2	30天-60天	0.44	-
3	60天-90天	22.65	-
其中:中期票据融资	-	0.19	-
4	90天-120天	41.30	-
其中:中期债券融资	-	-	-
5	120天-180天	2.68	-
其中:中期债券融资	-	0.22	-
6	180天-397天	22.05	-
其中:中期债券融资	-	-	-
合计	100.00	0.06	-

### 1.4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

### 1.5.报告期内投资组合平均剩余存续期分布比例

序号	项目	次数	
1	国家债券	39,622,230.06	0.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,226,321,899.32	5.06
其中:政策性金融债	5,226,321,899.32	5.06	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,485,810,864.73	10.16
6	中期票据	-	-
7	其他	14,305,177,528.27	13.86
8	合计	30,958,933,078.37	29.13
9	合计	30,958,933,078.37	29.13
10	债券正回购期间超过397天的浮动利率	885,002,414.82	0.86

### 1.6.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组合

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170207	17国债07	6,000,000	598,971,067.30	0.58
2	11178342	17广生银行CD009	6,000,000	596,071,179.29	0.58
3	170410	17国债10	5,200,000	518,954,750.02	0.50
4	170204	17国债04	5,100,000	508,500,151.31	0.49
5	11178246	17广生银行CD155	5,000,000	495,266,566.86	0.48
6	11178253	17国债三期FD174	5,000,000	495,266,566.86	0.48
7	11178278	17广生银行CD162	5,000,000	495,227,188.82	0.48
7	11178237	17国债中期FD174	5,000,000	495,180,500.58	0.48
8	11178190	17广生银行CD185	5,000,000	489,469,723.69	0.47
9	11178380	17广生银行CD167	5,000,000	489,341,301.21	0.47
10	11178344	17广生银行CD167	5,000,000	483,861,074.46	0.47

### 1.7.影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离程度
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	0.08776
报告期内偏离度的最低值	-0.03646
报告期内偏离度绝对值超过0.5%的情况次数	0.06195

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超过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超过0.5%。

1.8.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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142274	14国债01	1,100,000.00	110,000,000.00	0.11
2	146421	14国债01	1,000,000.00	100,000,000.00	0.10
2	116418	17广生银行CD141	1,000,000.00	100,000,000.00	0.10
3	178929	17国债21	800,000.00	79,791,311.66	0.08
4	178945	17广生银行CD141	1,000,000.00	100,000,000.00	0.10
5	178946	17国债11	500,000.00	28,590,571.00	0.03

### 1.9.投资组合报告附注

1.9.1  
本基金采用摊余成本法计价,即计价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,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金份额净值始终保持为1.00元。

1.9.2  
本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	628,462,976.36
4	应收申购款	57,144,917.63
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	685,607,893.99

1.9.4.投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

### 八、基金的投资

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资需谨慎。投资者做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、自基金合同生效以来(2013年12月3日)至2017年9月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金净值收益率①	业绩比较基准收益率②	绝对偏离③	相对偏离④
2013.12.3-2013.12.31				