

## 海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

海富通货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2004年11月19日出具的《关于同意海富通货币市场证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2004】194号文)批准募集。本基金的基金合同于2005年1月4日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

**重要提示**

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。本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《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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本招募说明书所载内容截止日为2007年6月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年6月30日,财务数据和净值表现未经审计。

**一、基金管理人**

(一)基金管理人概况  
名称:海富通基金管理有限公司  
注册地址:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼  
办公地址:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼  
法定代表人:邵国伟  
成立时间:2003年4月18日  
电话:021-68604999  
联系人:江璇  
注册资本:1.5亿元  
股权结构:海通证券股份有限公司51%、富通基金管理公司49%。

**(二)主要人员情况**

邵国伟先生,董事长,副教授。历任吉林大学党校副书记、长春师范学院党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心主任。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。  
吉宇光先生,董事,硕士,高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朝园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加(Stewart Edgar)先生,董事,英国籍,学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理,美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁,英国HD国际有限公司高级基金经理、董事,美国F&C管理公司高级基金经理、董事。1997年至今任海富通基金管理公司董事兼总经理。  
田仁灿先生,董事,总经理,比利时籍,工商管理学硕士。历任法国金融租赁Euroequipment SA公司总裁助理、富通银行区域经理、大中华地区主管、富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理公司董事、总经理。

张文伟先生,董事,副总经理,硕士,高级经济师。历任交通银行郑州分行信贷支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长、海富通办公室主任,海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

董文标先生,独立董事,硕士。历任交通银行郑州分行党委书记、行长,中国民生银行党委委员、副行长,中国民生银行党委书记、行长,现任中国民生银行党委书记、董事长、董事。

陈家强先生,独立董事,美国籍,博士,教授。历任美国俄亥俄州立大学财务系副教授,香港科技大学财务学教授,会计学系主任,香港科技大学工商管理学院院长助理。现任香港科技大学财务学系主任、香港科技大学工商管理学院院长。

巴约特(Marc Bayot)先生,独立董事,比利时籍,经济学学士。历任比利时通用银行证券分析、基金管理、公司财务等领域的业务主管,资产管理部总经理;比利时布鲁塞尔自由大学经济系教授。现任欧洲投资基金及投资企业协会名誉主席,“养老金基金”委员会主席,欧盟委员会“养老金基金论坛”委员,欧洲议会“养老金基金论坛”委员,INVESTPROTECT(布鲁塞尔)董事总经理。

杨国平先生,硕士,高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记,上海大众公用事业管理局党办副主任,上海市出租汽车公司党委书记,现任上海大众公用(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用(集团)股份有限公司董事长。

李陆前先生,监事长,经济学硕士,高级经济师。历任安徽省社联所属省新科技发展有限公司副总经理、海通证券财务会计部总经理、海通证券财务副总兼财务会计部总经理。

余毓繁先生,外籍华人,工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部副经理、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事兼总经理。现任富通银行亚洲区行政总监。  
罗万荣先生,监事,经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员,基金从业人员资格证书持有人,历任湖南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理,监察稽核部负责人。

童明女士,督察长,硕士。历任加拿大BBC Tech & Trade Int'l Inc公司高级产品经理,海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生,副总经理兼财务总监,硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司股票投资总监兼海富通精选基金基金经理,2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理,2006年3月至9月任海富通收益增长基金基金经理,2006年5月起,任海富通基金管理有限公司副总经理,2007年2月起,兼任海富通风格优势基金基金经理,2007年4月起,兼任海富通精选贰号基金经理。

阚小庆先生,副总经理兼市场业务总监,硕士。历任中国人民银行上海分行经济师,富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部经理,法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海市场代表,首席代表,2003年至今任海富通基金管理有限公司市场总监,2006年5月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈嘉琳先生,华东师范大学文学士,香港大学—复旦大学 MBA。2003年加盟海富通基金管理公司之前,先后在三和银行、嘉里证券和里昂证券从事商业银行信贷工作和证券市场的投资分析工作,现任海富通基金管理公司中国股票组合负责人。

牟永宁先生,经济学硕士,10年证券从业经历,持有基金从业人员资格证书和证券从业资格注册会计师资格证书。历任申银万国证券研究所分析师、高级分析师、副经理,申万巴黎基金管理公司高级分析师,美林证券(亚太区)资产管理部、投资银行部实习生经理。2004年8月加入海富通基金管理有限公司,任策略分析师,2006年9月至今任海富通基金管理有限公司研究负责人。

邵佳伟先生,硕士,学位,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券有限公司固定收益部业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资组合经理。2003年4月任海富通基金管理公司固定收益分析师,2005年1月起担任海富通货币市场基金基金经理,2006年5月起兼任海富通强化回报混合型证券投资基金基金经理。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会成员包括:田仁灿,总经理;陈洪,投资总监;陈家琳,股票组合负责人;牟永宁,研究负责人;杜晓海,定量分析师。投资决策委员会主席由总经理担任。上述人员涉及特定基金的,则该基金经理出席会议。

**二、基金托管人**

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称“中国银行”),基本情况如下:  
住所:北京市西城区复兴门内大街1号  
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号  
法定代表人:肖钢  
企业类型:股份有限公司  
注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰零陆万玖仟零玖元  
存续期间:持续经营  
成立日期:1983年10月31日  
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字【1998】24号  
托管部门总经理:秦立儒  
托管部门联系人:宁敏  
电话:(010)66594977  
传真:(010)66594942

**三、相关服务机构****(一)基金份额销售机构**

1.直销机构  
名称:海富通基金管理有限公司  
注册地址:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼  
办公地址:上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼  
法定代表人:邵国伟  
电话:021-68604999  
联系人:喻祥  
客户服务中心电话:021-38784858或40088-40099  
公司网站:www.hftfund.com  
2.代销机构  
(1)中国银行股份有限公司  
地址:北京市西城区复兴门内大街1号  
法定代表人:肖钢  
客户服务咨询电话:95566  
联系人:王薇  
(2)交通银行股份有限公司  
地址:上海市银城中路188号  
法定代表人:蒋超良  
客户服务统一咨询电话:95559  
电话:021-58781234  
联系人:曹榕  
(3)招商银行股份有限公司  
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
法定代表人:秦晓  
电话:(0755)82900600  
客户服务中心电话:95555  
联系人:刘薇  
(4)兴业银行股份有限公司  
地址:福州市湖东路154号  
法定代表人:高建平  
电话:95561  
联系人:陈晓瑜  
(5)深圳发展银行

地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦  
法定代表人:法兰克纽曼(Frank Neil Newman)  
客户服务统一咨询电话:95501  
电话:0755-82088888  
联系人:周勤

(6)上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号  
法定代表人:金运  
电话:021-61618888  
联系人:徐伟、汤嘉惠

(7)广东发展银行股份有限公司  
注册地址:广州市农林下路83号  
法定代表人:李华虹  
电话:020-38323704、38322730、38323206  
联系人:江璐、罗宇华

(8)整体配售策略  
根据宏观经济指标(主要包括:利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际间利率水平、汇率),决定债券资产的剩余期限(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、分拆转换进程),决定组合中各类资产的投资比例。

根据债券的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别。

(2)类别资产配置策略  
根据整体策略要求,决定组合中类别资产的配置内容和各别类资产的比例。

根据不同类别资产的流动性指标(二级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变动量、交易所),决定类别资产的当期配置比率。

根据不同类别资产的收益率水平(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类别资产收益差异)、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。

(3)明细资产配置策略  
第一步筛选,根据明细资产的剩余期限、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。

第二步筛选,根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)和剩余期限的对比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合。

第三步筛选,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。

3.投资管理方法  
(1)短期利率水平预期策略  
深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整货币资产的配置策略。

(2)收益曲线分析策略  
根据收益曲线的变化趋势,采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系,反映市场对较短期经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

(3)组合剩余期限策略、期限配置策略  
通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整,达到保持合理的现金流,锁定组合剩余期限,以满足可能的、突发的现金需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,根据收益率曲线的情况,投资一定剩余期限的品种,稳定收益,锁定风险,满足组合目标期限。

(4)类别品种配置策略  
在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性风险,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

(5)流动性管理策略  
在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他方式),在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

(6)无风险套利策略  
无风险套利策略包括:  
跨市场套利策略:根据各细分市场金融工具的流动性和收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。

跨品种套利策略:根据各细分市场不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,动态调整不同期限结构品种的资产配置比例。

(7)滚动调整策略  
根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续的变现能力。

(8)根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续的变现能力。

九、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:税后一年期银行定期存款利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下,本基金管理人可根据投资目标和投资策略,确定变更业绩比较基准,并及时公告。

本基金管理人认为,业绩的选择标准需要合理、透明,为广大投资者所接受。业绩基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。

十、基金的风险收益特征  
本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基金品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金

十一、基金的投资组合报告  
基金管理人及董事会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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年7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。

本投资组合报告中财务数据截至2007年6月30日(“报告期末”)的季报数据,本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金投资组合

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	629,040,040.14	84.68%
买入返售证券	400,000,000.00	52.60%
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	126,238,475.51	8.89%
其中:定期存款	0.00	0.00
其他资产	254,226,540.06	10.65%
合计	1,409,568,055.71	100.00%

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6,326,870,000.00	68.00%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00
2	报告期内债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00

注:上表中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报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的平均值。本报告期内无货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况。

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

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(%)
30天以内	42.08	9.61
30天(含)-60天	0.00	0.00
60天(含)-90天	0.00	0.00
90天(含)-180天	5.48	0.00
180天(含)-397天(含)	44.91	0.00
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债	4.03	0.00
合计	92.47	9.61

(2)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	42.08	9.61
2	30天(含)-60天	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	5.48	0.00
5	180天(含)-397天(含)	44.91	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债	4.03	0.00
合计		92.47	9.61

4.报告期末债券投资组合  
(1)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债债券	0.00	0.00
2	金融债券	0.00	0.00
3	其中:政策性金融债	0.00	0.00
4	央行票据	431,326,264.43	34.56%
5	企业债券	147,416,818.14	11.81%
6	商业银行次级债	50,300,967.57	4.03%
7	合计	629,040,040.14	84.40%
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	50,300,967.57	4.03%

上表中,付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收利息。

(2)基金投资组合前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量	成本(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	07央行票据 02	1,900,000	0.00	196,795,753.17	14.97%
2	07央行票据 18	1,500,000	0.00	146,869,698.42	11.77%
3	07央行票据 31	1,000,000	0.00	97,660,802.84	7.82%
4	招商债 CP01	700,000	0.00	68,456,847.10	5.48%
5	07央行票据 03	500,000	0.00	50,300,967.57	4.03%
6	07央行票据 C901	500,000	0.00	49,889,236.32	4.00%
7	07国债 CP01	300,000	0.00	28,974,736.72	2.32%
8	合计				
9	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券				
10					

上表中,“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购买入的债券卖出后的余额。

5.“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

序号	项目	偏离度
1	报告期内偏离度的绝对值在0.25%-0.5%间的次数	0
2	报告期内偏离度的最高值	0.1264%
3	报告期内偏离度的最低值	-0.0009%
4	报告期内偏离度的平均值	0.0571%

注:以上数据按工作日统计

6.投资组合报告附注  
(1)基金计价方法说明。

**六、基金的投资目标**

本基金的投资目标为:在力争本金安全和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的收益。

**七、基金的投资方向**

本基金投资于如下的金融工具:现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;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)的中央银行票据以及中国证监会、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。

**八、基金的投资策略****1. 决策依据**

(1)投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;  
(2)投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;  
(3)投资部策略分析师、固定收益分析师、定量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)整体资产配置策略  
根据宏观经济指标(主要包括:利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际间利率水平、汇率),决定债券资产的剩余期限(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、分拆转换进程),决定组合中各类资产的投资比例。

根据债券的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别。

(2)类别资产配置策略  
根据整体策略要求,决定组合中类别资产的配置内容和各别类资产的比例。

根据不同类别资产的流动性指标(二级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变动量、交易所),决定类别资产的当期配置比率。

根据不同类别资产的收益率水平(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类别资产收益差异)、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。

(3)明细资产配置策略  
第一步筛选,根据明细资产的剩余期限、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。

第二步筛选,根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)和剩余期限的对比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合。

第三步筛选,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。

3.投资管理方法  
(1)短期利率水平预期策略  
深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整货币资产的配置策略。

(2)收益曲线分析策略  
根据收益曲线的变化趋势,采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系,反映市场对较短期经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

(3)组合剩余期限策略、期限配置策略  
通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整,达到保持合理的现金流,锁定组合剩余期限,以满足可能的、突发的现金需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,根据收益率曲线的情况,投资一定剩余期限的品种,稳定收益,锁定风险,满足组合目标期限。

(4)类别品种配置策略  
在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性风险,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

(5)流动性管理策略  
在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他方式),在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

(6)无风险套利策略  
无风险套利策略包括:  
跨市场套利策略:根据各细分市场金融工具的流动性和收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。

跨品种套利策略:根据各细分市场不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,动态调整不同期限结构品种的资产配置比例。

(7)滚动调整策略  
根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续的变现能力。

九、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:税后一年期银行定期存款利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下,本基金管理人可根据投资目标和投资策略,确定变更业绩比较基准,并及时公告。

本基金管理人认为,业绩的选择标准需要合理、透明,为广大投资者所接受。业绩基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。

十、基金的风险收益特征  
本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基金品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金

十一、基金的投资组合报告  
基金管理人及董事会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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年7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。

本投资组合报告中财务数据截至2007年6月30日(“报告期末”)的季报数据,本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金投资组合

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	629,040,040.14	84.68%
买入返售证券	400,000,000.00	52.60%
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	126,238,475.51	8.89%
其中:定期存款	0.00	0.00
其他资产	254,226,540.06	10.65%
合计	1,409,568,055.71	100.00%

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6,326,870,000.00	68.00%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00
2	报告期内债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00

注:上表中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报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的平均值。本报告期内无货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况。

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

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(%)
30天以内	42.08	9.61
30天(含)-60天	0.00	0.00
60天(含)-90天	0.00	0.00
90天(含)-180天	5.48	0.00
180天(含)-397天(含)	44.91	0.00
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债	4.03	0.00
合计	92.47	9.61

(2)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	42.08	9.61
2	30天(含)-60天	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	5.48	0.00
5	180天(含)-397天(含)	44.91	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债	4.03	0.00
合计		92.47	9.61

4.报告期末债券投资组合  
(1)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国债债券	0.00	0.00
2	金融债券	0.00	0.00