

## 交银施罗德货币市场证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司 基金托管人:中国农业银行

(2007年第3号)

## 【重要提示】

交银施罗德货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经2006年12月21日中国证券监督管理委员会证监基金字【2006】204号文核准募集。本基金基金合同于2006年1月20日正式生效。

基金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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

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,但投资者购买本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,本基金管理人不对本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者在认(申)购本基金前应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的成绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为2007年7月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况  
名称:交银施罗德基金管理有限公司  
住所:上海市交通银行大楼二层(裙)  
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号交银金融大厦  
法定代表人:谢红兵  
成立日期:2006年8月4日  
注册资本:贰亿元人民币  
存续期间:持续经营  
电话:(021)61050600  
传真:(021)61056034  
联系人:陈蔚

交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监基金字[2006]128号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设合规审核委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会,有针对性地研究公司在经营管理与基金运作中的相关情况,制定相应的政策,并充分发挥独立董事的客观、切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由三位监事组成,主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营管理由总经理负责,下设内部控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会和三位总监:市场总监、分管产品开发及市场营销,投资总监,分管研究、投资和交易;营运总监,分管人力资源、财务、信息技术及清算登记。此外,监察稽核由督察长协同总经理直接管理。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

截止至2007年7月20日,公司有员工108人,其中63%以上的员工具有硕士以上学历。

公司已建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度。

## (二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员  
谢红兵先生,董事长,双学士学历。历任交通银行上海分行杨浦支行副行长、行长、静安支行行长,交通银行总行基金托管部副总经理、总经理。

吴伟先生,董事,博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长,现任交通银行总行预防部副总经理。

金大建先生,董事,硕士学历。历任交通银行调查部副处长、总经理助理、副总经理、总经理,交通银行上海分行副行长、交通银行南京分行行长、交通银行上海分行行长、交通银行预防财务部总经理兼综合经营办主任,现任交通银行投资管理部总经理。

周刚女士,董事,学士学历。历任交通银行信贷部资产处置处副主任、主管,交通银行信贷部风险管理处副处长,交通银行风险管理部债权处副处长、处长,现任交通银行资产保全部总经理。

雷贤达先生,董事、总经理,学士学历,加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、宝源投资管理(香港)有限公司执行董事。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

葛达庆先生,董事,大专学历。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术本部董事、施罗德集团首席营运师,现任施罗德集团亚太区总监。

孙祁祥女士,独立董事,博士学历,国务院政府特殊津贴专家,博士生导师。现任北京大学经济学院院长、风险管理及保险学系主任。

王松奇先生,独立董事,博士学历。历任中国人民大学讲师,中国社会科学院财贸研究所金融研究中心研究员,现任中国社会科学院金融研究中心副主任、研究员,北京创业投资协会常务理事兼秘书长。

陈家乐先生,独立董事,博士学历。历任香港科技大学金融学系副教授、教授,现任香港科技大学金融学系系主任。

2、基金管理人监事会成员  
尹宝玉女士,监事,学士学历,高级经济师,历任交通银行国外业务部总经理,交通银行常务董事,交通银行系统工会专职副主任、常务董事,主任,经公司股东会2007年第三次会议通过,免去公司监事尹宝玉女士职务,选举徐俊康先生担任公司董事。

徐俊康先生,监事,学士学历。曾任职于中国人民银行长宁区办事处和工商银行长宁区办事处,历任交通银行上海分行人事教育处副处长,交通银行人事教育部副总经理、总经理,交通银行党委委员、纪委书记。

金玉凤女士,监事,学士学历。历任海通证券有限公司办公室副主任(主持工作)、交通银行信托部主任科员,交通银行基金托管部综合处副处长,交通银行资产托管部客服服务处处长,现任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

袁庆霞女士,监事,CFA、FRM,双硕士学位。历任宝源投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、业务延续计划的负责人。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员,负责营运及IT部分。现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理。

3、公司高管人员  
谢红兵先生,董事长,双学士学历。历任交通银行上海分行杨浦支行副行长、行长、静安支行行长,交通银行总行基金托管部副总经理、总经理。

雷贤达先生,董事、总经理,学士学历,加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、宝源投资管理(香港)有限公司执行董事。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

吴建中先生,督察长,大专学历。历任交通银行宁波分行副行长、行长,交通银行风险管理部副总经理、总经理,交通银行宁波分行行长、党委书记。

许珊珊女士,副总经理,硕士学历,高级经济师。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司副经理,基金管理部总经理,湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

莫泰山先生,副总经理,硕士学历。历任中国证券监督管理委员会基金监管部副处长、办公厅主任,基金监管部处长。

4、本基金基金经理  
陈晓秋女士,基金经理,硕士学历。5年基金公司债券研究及投资经验;曾任富国基金管理有限公司研究策略部和投资部研究员,负责债券及宏观分析,债券投资。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。2006年1月20日起担任本基金基金经理至今。

李家春先生,基金经理,学士学历。8年证券、基金从业经历。历任长江证券有限责任公司投资经理,汉唐证券有限责任公司高级经理、投资主管,泰信基金管理有限公司研究员。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司,2006年12月27日起担任本基金基金经理至今。

5、投资决策委员会成员  
主席:李旭利(投资总监)

委员:雷贤达(董事、总经理)

莫泰山(副总经理)

赵巍(基金经理)

陈晓秋(基金经理)

周伟桂(基金经理)

李立(基金经理)

李家春(基金经理)

郑拓(基金经理)

上述人员之间无近亲属关系。

## 二、基金托管人

1、基本情况  
名称:中国农业银行  
住所:北京市复兴路甲23号  
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号  
法定代表人:项俊波  
成立时间:1979年2月23日  
注册资金:361亿元人民币  
存续期间:持续经营  
电话:(010)68424199  
联系人:李芳菲

中国农业银行是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。在国内,中国农业银行网点遍布城乡,资金实力雄厚,服务功能齐全,不仅为广大客户所信赖,而且与他们一道取得了长足的共同进步,已成为中国最大的银行之一。在海外,农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,被《财富》评为世界500强企业之一。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。中国农业银行自1979年恢复成立以来,在社会各界的大力支持下,全行员工开拓创新,奋力拼搏,在建设现代商业银行的征途上,积极实践,勇于实践,资金实力显著增强,业务领域不断拓宽,经营结构逐年优化,财务收益大幅跃升,管理水平不断提高,在支持国民经济发展、为客户提供优质服务的同时,自身不断成长壮大。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被美国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国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农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国银监会批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处,境外资产托管处和投资银行处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监控快捷的技术系统。

2、主要人员情况  
中国农业银行托管业务部现有员工77名,其中硕士与博士42人,高级会计师、高级经济师、高级工程师10余人,服务团队成员都具有高素质高学历的托管业务能力,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称。

## 3、基金托管业务经营情况

截止2007年6月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共51只,包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景福、基金天华、基金同德、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、鹏华成长价值增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、交银施罗德成长证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力成长型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金,托管基金份额达1524亿份。

## 三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构  
1、直销机构  
本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。  
机构名称:交银施罗德基金管理有限公司  
住所:上海市交通银行大楼二层(裙)  
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号交银金融大厦  
法定代表人:谢红兵  
电话:(021)61056023  
传真:(021)61056054  
联系人:彭媛  
客户服务电话:(021)61056000  
网址:www.jsrd.com或www.bocomschroder.com

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务,具体交易规则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.jsrd.com或www.bocomschroder.com

## 2、代销机构

(1)中国工商银行  
住所:北京市西城区复兴路甲23号  
办公地址:北京市海淀区建国门内大街69号  
法定代表人:项俊波  
传真:(010)851109219  
客户服务电话:96599  
网址:www.icbcchina.com

(2)交通银行  
住所:上海市浦东新区银城中路188号  
办公地址:上海银城中路188号  
法定代表人:蒋超良  
电话:(021)58781234  
传真:(021)58408942  
联系人:曹榕  
客户服务电话:96599  
网址:www.bankcomm.com

(3)广东发展银行股份有限公司  
住所:广州市农林下路83号  
法定代表人:李若虹  
联系人:詹全鑫、张次大  
客户服务电话:(020)38322542、38322974  
网址:ebank.gdcb.com.cn

(4)光大证券股份有限公司  
住所:上海市浦东新区银城中路528号上海证券大厦南塔16楼  
办公地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼  
法定代表人:王明凯  
电话:(021)68816000  
联系人:刘晨  
客户服务电话:10108998  
网址:www.ebscn.com

(5)国泰君安证券股份有限公司  
住所:上海市浦东新区商城路618号  
办公地址:上海市延平路135号  
法定代表人:祝幼一  
电话:(021)62580818  
传真:(021)62569400  
联系人:芮敏祺  
客户服务电话:(021)962588、400-8888-666  
网址:www.gtja.com

(6)中信建投证券股份有限公司  
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址:北京市朝阳门内大街188号  
法定代表人:王开国  
电话:(021)53594566  
传真:(010)58385849  
联系人:金芸、杨薇  
客户服务电话:(021)962503、400-8888-001  
网址:www.hsbc.com

(7)海通证券股份有限公司  
住所:上海市淮海中路98号  
办公地址:上海市淮海中路98号  
法定代表人:王开国  
电话:(021)53594566  
传真:(010)58385849  
联系人:金芸、杨薇  
客户服务电话:(021)962503、400-8888-001  
网址:www.htsec.com

(8)广发证券股份有限公司  
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室  
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路11号  
法定代表人:王石伟  
电话:(020)87565888-875  
传真:(020)87565986  
联系人:肖鸣春  
客户服务电话:(020)87565888-875  
网址:www.gf.com

(9)招商证券股份有限公司  
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层  
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层  
法定代表人:宫少林  
电话:(0755)82943666  
传真:(0755)82960140  
联系人:黄健  
客户服务电话:(0755)26951111、400-8888-111  
网址:www.newone.com.cn

(10)兴业证券股份有限公司  
住所:福州市湖东路99号标力大厦  
办公地址:上海浦东新区银城中路166号中保大厦  
法定代表人:兰荣  
电话:(021)68419974  
传真:(021)68419887  
联系人:杨盛芳  
客户服务电话:(021)68419974  
网址:www.xyzq.com.cn

(12)中信证券股份有限公司  
住所:深圳市罗湖区笋岗路1030号华龙大厦  
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层  
法定代表人:王东明  
电话:(010)94865266  
传真:(010)94865660  
联系人:陈忠  
客户服务电话:(010)84588903  
网址:www.citic.com

(13)湘财证券有限责任公司  
住所:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼  
办公地址:上海浦东新区银城中路139号华能联合大厦五层  
法定代表人:陈新军  
电话:(021)68634318  
传真:(021)60643470  
联系人:陈伟  
客户服务电话:(021)68865020或当地营业部客服电话  
网址:www.xcsc.com

(14)国都证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区华强北路赛格广场45层  
办公地址:上海市常熟路171号  
法定代表人:王少华  
电话:(010)64482828-390  
联系人:马泽承

客户服务电话:800-810-8809(免长途话费)  
网址:www.guodu.com

(15)申银万国证券股份有限公司  
住所:上海市常熟路171号  
办公地址:上海市常熟路171号  
法定代表人:丁国荣  
电话:(021)54033888  
联系人:黄唯琳  
客户服务电话:(021)962506  
网址:www.sw2000.com.cn

(16)华泰证券股份有限公司  
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦  
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦  
法定代表人:吴万善  
电话:(025)84457777-950、248  
传真:(025)84579778  
联系人:李金龙、张小波  
客户服务电话:(025)84579897  
网址:www.htsc.com.cn

(17)中信信通证券有限责任公司  
住所:浙江省杭州市中河南路11号凯悦庭商务楼A座  
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号凯悦庭商务楼A座  
法定代表人:刘军  
电话:(0571)85783715  
传真:(0571)85783771  
联系人:王勤  
客户服务电话:(0571)96598  
网址:www.bigsun.com.cn

(18)中银国际证券有限责任公司  
住所:上海银城中路200号39层  
办公地址:中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层  
法定代表人:平岳  
联系人:张静  
客户服务电话:400-620-8888  
网址:www.bocichina.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

(二)注册登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层  
办公地址:北京市西城区金融大街23层  
法定代表人:陈耀先  
电话:(010)58598839  
传真:(010)58598834  
联系人:朱立元  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海泰源律师事务所  
住所:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室  
办公地址:上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室  
负责人:廖海  
电话:(021)51151028  
传真:(021)51151038  
联系人:廖海  
经办律师:廖海、吕红  
(四)审计基金财产的会计师事务所  
名称:德勤华永会计师事务所有限公司  
住所:上海市延安路222号30楼  
办公地址:上海市延安路222号30楼  
法定代表人:郑树成  
电话:(021)61418888  
传真:(021)63350177  
联系人:陶莹  
经办注册会计师:陶莹、刘明华

## 四、基金的名称

本基金名称:交银施罗德货币市场证券投资基金

## 五、基金的投资

本基金类型:契约型开放式

## 六、基金的投资目标

本基金投资于货币市场基金,投资目标是在力求本基金稳妥和资产充分流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。

## 七、基金的投资方向

本基金主要投资于货币市场工具,包括:  
1、现金;  
2、通知存款;  
3、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;  
4、剩余期限在397天以内(含397天)的债券;  
5、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;  
6、期限在一年以内(含一年)的债券回购;  
7、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

(一)短期利率走势预期策略  
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,并据此调整基金货币资产的配置策略。

(二)收益曲线分析策略  
根据收益曲线率的变化趋势,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,反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

(三)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。

(四)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利率,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

(五)流动性管理策略  
在满足基金投资者申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产的安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理以及其他措施),在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

(六)无风险套利策略  
跨市场套利策略包括:  
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。如,当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包含一级市场发行定价和二级市场流通成交价之间的无风险套利机会。

跨品种套利策略:根据各细分市场中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配置比例。

(七)滚动配置策略  
根据具体投资品种的市场特征,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续变现能力。如,对N天回购协议进行每天等量配置,提高基金资产的流动性;在公开市场操作中,跟踪人民银行每周的滚动发行,持续回品种投资,达到剩余期限的均匀分布。

(八)信用利差策略  
通过对资产支持证券的信用评估,分析预期违约率和违约损失率的变化趋势,评估其信用利差是否合理,并预测其变化趋势,通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

九、基金的业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为六个月银行定期存款利率(税后)。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用,基金管理人可根据市场发展状况及本基金的资产配置和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征  
本货币市场基金具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

十一、基金投资组合报告  
本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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2007年7月18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。

本投资组合报告期为2007年4月1日至2007年6月30日,所载财务数据未经审计师审计。

(一)本报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
债券投资	898,076,572.91	96.37%
买入返售债券	10,000,000.00	1.07%
其中:买断式回购的买入返售债券	-	-
银行存款和清算备付金合计	18,706,951.40	2.01%
其他资产	5,098,546.33	0.56%
合计	931,882,069.64	100.00%

(二)报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例
1	报告期末债券回购融资余额	3,100,920,000.00	11.80%
	其中:买断式回购融入的资金	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	114,000,000.00	14.41%
	其中:买断式回购融入的资金	-	-

(三)本基金费用与支付费用的期限

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	164
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	177
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	98

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	9.94%	15.68%
2	30(天)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.22%	-
3	60(天)-90天	13.90%	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	6.32%	-
4	90(天)-180天	26.27%	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.48%	-
5	180(天)-397(天)	59.84%	-
	合计	117.17%	15.68%

(四)报告期末债券投资组合

1.投资组合品种的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	-	-
2	金融债券	159,474,710.60	20.16%
	其中:政策性金融债	159,474,710.60	20.16%
3	央行票据	424,686,885.13	53.70%
4	企业债券	313,906,007.18	39.69%
5	其他	-	-
	合计	898,076,572.91	113.56%

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券

2.基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	07央行票据06	1,900,000	-	186,906,722.66	23.63%
2	06央行票据78	1,400,000	-	138,690,796.16	17.54%
3	06进出05	600,000	-	59,591,964.60	7.59%
4	06首都机场债	570,000	-	57,134,207.39	7.22%
5	07中债CP01	500,000	-	50,017,734.83	6.32%
6	05国开07	500,000	-	49,975,866.32	6.32%
7	06央行票据53	500,000	-	49,902,074.13	6.31%
8	07进出01	500,000	-	49,506,889.68	6.26%
9	07央行票据09	500,000	-	49,198,262.28	6.22%
10	07央行CP01	400,000	-	39,134,000.48	4.96%

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期末偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期末偏离度的最高值	0.12%
报告期末偏离度的最低值	0.00%
报告期末每个工作日前偏离度的绝对值的简单平均值	0.05%

(六)投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未采用调查成本前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2)本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列价,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提损益。

(3)本基金投资期间每日持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本均未超过当日基金资产净值的20%。

(4)本报告期内需调整的证券投资决策程序:无。