

信息披露

Disclosure

(上接B73版)

网站: www.longone.com.cn
 客户服务电话: 09531-400-889-8588
 (84) 恒泰证券股份有限公司
 住所: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
 办公地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
 法定代表人: 庞介民
 电话: 021-69062733
 传真: 021-68406181
 联系人: 张同庆
 网站: www.znht.com.cn
 客户服务电话: 0471-4961259
 (85) 国盛证券有限责任公司
 住所: 南昌市北京西路98号江信国际金融大厦
 办公地址: 江西省南昌市北京西路98号江信国际大厦4层
 法定代表人: 曾小雷
 电话: 0791-8623080
 传真: 0791-86281306
 联系人: 俞皓
 网站: www.gsstock.com
 客户服务电话: 0791-4295337
 (86) 齐鲁证券有限公司
 住所: 山东省济南市市中区经七路86号
 办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号
 法定代表人: 李玮
 电话: 0531-68889155
 联系人: 吴昊
 网站: www.qlzq.com.cn
 客户服务电话: 95638
 (87) 世纪证券有限责任公司
 住所: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
 办公地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
 法定代表人: 卢长才
 客户服务电话: 0755-83199511
 传真: 0755-83190545
 联系人: 刘雪辉
 网站: www.cscso.com.cn
 (88) 第一创业证券股份有限公司
 住所: 广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
 办公地址: 深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
 法定代表人: 刘学民
 电话: 0755-23831754
 传真: 0755-25837670
 联系人: 毛诗莉
 网站: www.firstcapital.com.cn
 客户服务电话: 400-888-1888
 (89) 金元证券股份有限公司
 住所: 海口市南沙路36号证券大厦4楼
 办公地址: 深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
 法定代表人: 陆海
 电话: 0755-83025022
 传真: 0755-83025625
 联系人: 马慧菁
 网站: www.jyzq.cn
 客户服务电话: 400-888-8228
 (90) 中航证券有限公司
 住所: 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A栋41层
 办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A栋41层
 法定代表人: 王宜四
 电话: 0791-86779681
 传真: 0791-86770178
 联系人: 戴璐
 网站: www.avicsec.com
 客户服务电话: 400-886-6567
 (91) 华林证券股份有限公司
 住所: 深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6层
 办公地址: 深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6层
 法定代表人: 薛荣年
 电话: 0755-8207885
 传真: 0755-23613751
 联系人: 杨玲
 网站: www.hualin.com.cn
 客户服务电话: 400-188-3888
 (92) 德邦证券股份有限公司
 住所: 上海市普陀区曹杨路510号明珠幢4楼
 办公地址: 上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
 法定代表人: 文晔平
 电话: 021-68761044-8522
 传真: 021-68767032
 联系人: 叶蕾
 网站: www.tebon.com.cn
 客户服务电话: 400-888-8128
 (93) 西部证券股份有限公司
 住所: 陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17楼
 办公地址: 陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17楼
 法定代表人: 刘建武
 电话: 029-87417129
 传真: 029-8742426
 联系人: 刘莹
 网站: www.westsecu.com
 客户服务电话: 95582
 (94) 华鑫证券有限责任公司
 住所: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层
 办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦7至10层
 法定代表人: 黄金豪
 电话: 0591-87383623
 传真: 0591-87383610
 联系人: 张蓉
 网站: www.hfzq.com.cn
 客户服务电话: 0591-96326
 (95) 华龙证券有限责任公司
 住所: 甘肃省兰州市静宁路308号
 办公地址: 甘肃省兰州市静宁路308号
 法定代表人: 李晓安
 电话: 0931-4891100
 联系人: 李莉丹
 网站: www.hlzqgs.com
 客户服务电话: 0931-4890619、4890618、4890100
 (96) 中国国际金融有限公司
 住所: 北京市建国门外大街2号国贸大厦2座27层及28层
 办公地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
 法定代表人: 金立群
 电话: 010-65051166
 传真: 010-55650805
 联系人: 罗春蓉、谢明
 网站: www.cicc.com.cn
 客户服务电话: 010-65051166
 (97) 招商证券股份有限公司
 住所: 深圳市福田区福华路15号嘉华国际商务中心
 办公地址: 深圳市福田区福华路15号嘉华国际商务中心
 法定代表人: 林永钦
 电话: 0671-87925129
 传真: 0671-87818329
 联系人: 夏吉春
 网站: www.citicsec.com
 客户服务电话: 0571-96336
 (98) 中国中投证券有限责任公司
 住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.20.21.22.23号
 办公地址: 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
 法定代表人: 尤增来
 电话: 0755-82023442
 传真: 0755-82026539
 联系人: 刘璇
 网站: www.china-invs.cn
 客户服务电话: 400-666-8088、95532
 (99) 江海证券有限公司
 住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
 办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
 法定代表人: 孙名扬
 电话: 0451-85863719
 联系人: 刘璇
 网站: www.jhzq.com.cn
 客户服务电话: 400-666-2288
 (100) 国金证券股份有限公司
 住所: 成都市青羊区东城根上街95号
 办公地址: 成都市青羊区东城根上街95号
 法定代表人: 冉云
 电话: 028-86690070
 传真: 028-86690126
 联系人: 刘一宏
 网站: www.gjzq.com.cn
 客户服务电话: 400-666-1111(四川地区)、400-666-0109(全国)
 (101) 中国民族证券有限责任公司
 住所: 北京市朝阳区金台路2号民族大厦6层-9层
 办公地址: 北京市朝阳区金台路2号民族大厦6层-9层
 法定代表人: 赵建超
 电话: 010-59355941
 传真: 010-66553791
 联系人: 李微
 网站: www.zmzq.com.cn
 客户服务电话: 400-889-5618
 (102) 宏信证券有限责任公司
 住所: 四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
 办公地址: 四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
 法定代表人: 吴玉明
 电话: 028-86199278
 传真: 028-86199382
 联系人: 郝俊虎
 网站: www.hxzq.cn
 客户服务电话: 400-836-6366
 (103) 太平洋证券股份有限公司
 住所: 云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
 办公地址: 北京市西城区北展北街9号华远企业D座3单元
 法定代表人: 李长伟
 电话: 010-83217717、18500505235
 传真: 010-83213763
 联系人: 唐田田
 网站: www.tpyzq.com
 客户服务电话: 400-665-0999
 基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金, 并及时公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售机构(网点)。

住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场东经贸城安永大楼(东三办公楼)16层
 办公地址: 北京市东长安街1号东方广场东经贸城安永大楼16层
 执行事务合伙人: 吴港平
 电话: 010-58153000
 传真: 010-58138228
 联系人: 徐德
 经办注册会计师: 徐德、陈琳达

四、基金名称
 本基金名称: 华夏货币市场基金。

五、基金的类型
 本基金类别: 契约型开放式。

六、基金份额的类别
 (一) 基金份额的类别
 本基金根据投资者申购A级基金份额, 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, 因此形成不同基金份额类别。本基金设A级和收益类基金份额, 两类基金份额单独设置基金代码, 并分别公布每万份基金净收益、七日年化收益率。

(二) 基金份额类别的限制
 1. 若本基金A级基金份额持有人单个基金账户内, 在同时销售本基金A级和收益类基金份额的销售机构构成组合的基金份额达到或超过500万份时, 本基金的登记结算机构将自动将该部分A级基金份额升级为收益类基金份额。

2. 若本基金收益类基金份额持有人单个基金账户内, 在同时销售本基金A级和收益类基金份额的销售机构构成组合的基金份额低于500万份时, 本基金的登记结算机构将自动将该部分B级基金份额升级为A级基金份额。

3. 投资者需注意, 登记结算机构仅针对投资者在同时销售本基金A级和收益类基金份额的销售机构内的基金份额进行升降级的判断和自动升降级处理, 若销售机构仅销售A级或收益类基金份额, 则投资者在该机构内的基金份额不参与升降级的判断和处理。

(四) 重要提示
 1. 投资者应实际持有的基金份额类别以本基金的登记结算机构根据上述业务规则确认的基金份额类别为准。

2. 本基金A级、收益类基金份额的基金代码不同, 投资者在提交赎回等交易申请时, 应正确填写基金份额的代码, 因错误填写基金份额代码所造成的赎回等交易申请确认失败的风险由投资者自行承担。

3. 若本基金发生终止交易时, 在基金开放日对投资者持有的基金份额进行了升降级处理, 则投资者在该日对升降级前的基金份额提交的赎回、转换转出及转托管(若有)等申请可确认失败。

(五) 基金管理人可以在不违反法律法规的情况下, 增加新的基金份额类别, 或者调整现有基金份额类别设置及各类别的服务费率、数据频率, 相关规则和本基金销售机构的具体销售机构, 或者停止现有基金份额类别的销售等, 并在更新的招募说明书或相关公告中披露。

七、基金的投资目标
 在保持安全性、高流动性的前提下, 获得高于业绩比较基准的回报。

八、基金的投资方向
 本基金投资于具有良好流动性的货币市场工具, 主要包括以下: 现金; 一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单; 剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)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)的银行承兑票据; 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。

在有关法律法规允许交易短期融资券的情况下, 本基金可在法律法规允许的范围内, 投资于短期融资券。

九、基金的投资策略
 结合货币市场利率的预测与现金流安排, 采取现金流管理策略进行货币市场工具投资, 以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上, 获得较高的收益。

研判货币市场利率: 货币市场利率预测是进行货币市场投资的基础, 本基金建立利率分析系统, 通过分析国内外宏观经济发展、央行的货币政策及公开市场操作、市场资金面的宽松程度等对货币市场利率的走势进行预测。

根据货币市场利率水平的预测确定组合的平均剩余期限。当预测货币市场利率上升时, 适当缩短投资组合的平均剩余期限, 降低利率水平下降时, 适当延长投资组合的平均剩余期限。在预测剩余期限决定了组合的风险收益水平, 本基金的平均剩余期限控制在180天之内。

结合收益率曲线的研究进行利率期限结构管理, 确定组合期限结构的分布方式, 合理配置不同期限品种的资产配置比例。

在确定组合剩余期限和期限结构分布的基础上, 根据各品种的流动性、收益性以及信用风险确定各子类别的配置权重, 即确定短期融资券、央行票据、回购以及现金等资产的比例。

采取现金流管理策略: 在动态分析、规划、测算组合内现金流、申购赎回净现金流的基础上, 合理配置和动态调整组合现金流。在满足日常流动性要求的基础上, 最大限度减少冲击成本, 实现组合流动性要求和收益期望的合理配置。

运用系统化的量化分析策略, 寻求无风险的套利机会, 在规避市场波动性的同时获取更高的投资收益。

本基金将本着谨慎性原则进行资产支持证券, 按照资产支持证券定价模型对资产支持证券进行估值, 通过持续的信用评估和跟踪, 量化模型管理, 投资风险控制等方法对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制, 并在此基础上提高组合收益。基金管理人将综合运用久期管理、个券选择、信用产品交易策略等各种策略, 精选品种, 为基金份额持有人获取长期稳定收益。

十、基金的风险收益特征
 本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款税后收益率为业绩比较基准。"一年期定期存款收益率"是指中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。

在合理的市场化利率基准准出的情况下, 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。

十一、基金的风险收益特征
 本基金投资于货币市场工具, 属于低风险品种。

十二、基金的投资组合报告
 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。基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2015年4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, 保证本报告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2015年3月31日, 本报告中列示的数据未经审计。

(一) 报告期末基金资产组合情况
 金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益类资产	2,970,048,296.82	97.77
2	权益类资产	2,970,048,296.82	97.77
3	其他资产	—	—
4	负债及所有者权益	—	—
5	合计	7,940,206,593.64	100.00

(二) 报告期末债券回购融资情况
 金额单位: 人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额最高值	14.27
2	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
3	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
4	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
5	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
6	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
7	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
8	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
9	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
10	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
11	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
12	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
13	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
14	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
15	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
16	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
17	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
18	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
19	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
20	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
21	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
22	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
23	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
24	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
25	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
26	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
27	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
28	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
29	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
30	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
31	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
32	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
33	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
34	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
35	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
36	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
37	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
38	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
39	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
40	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
41	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
42	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
43	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
44	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
45	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
46	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
47	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
48	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
49	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
50	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
51	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
52	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
53	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
54	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
55	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
56	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
57	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
58	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
59	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
60	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
61	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
62	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
63	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
64	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
65	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
66	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
67	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
68	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
69	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
70	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
71	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
72	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
73	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
74	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
75	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
76	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
77	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
78	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
79	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
80	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
81	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
82	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
83	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
84	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
85	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
86	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
87	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
88	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
89	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
90	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
91	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
92	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
93	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
94	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
95	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
96	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
97	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
98	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
99	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
100	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
101	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
102	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
103	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
104	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
105	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
106	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
107	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
108	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
109	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
110	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
111	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
112	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
113	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
114	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
115	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
116	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
117	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
118	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
119	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
120	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
121	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
122	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
123	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
124	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
125	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
126	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
127	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
128	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
129	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
130	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
131	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
132	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
133	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
134	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
135	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
136	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
137	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
138	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
139	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
140	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
141	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
142	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
143	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
144	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
145	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
146	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
147	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
148	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
149	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
150	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
151	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
152	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
153	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
154	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
155	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
156	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
157	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
158	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
159	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
160	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
161	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
162	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
163	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
164	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
165	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
166	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
167	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
168	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
169	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
170	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
171	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
172	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
173	报告期内债券回购融资余额最高值占比	0.16
174	报告期内债券回购融资余额最高值占比	