

(上接B056版)

(77) 国泰君安证券股份有限公司 住所:上海市浦东新区世纪大道1609号 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号 法定代表人:杨红珍 电话:021-68888666 网址:www.gtja.com.cn	(78) 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:北京市朝阳区安立路66号4号楼 法定代表人:王常青 电话:010-85878888 网址:www.csc102.com	(79) 国信证券股份有限公司 住所:广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址:深圳市福田区益田路4068号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人:何如 电话:0755-82130833 网址:www.guosen.com.cn
(80) 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A座36-46层 办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座36-46层 法定代表人:霍达 电话:0755-82943666 网址:www.cmschina.com	(81) 广发证券股份有限公司 住所:广州天河区马场路26号广发证券大厦43楼 办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦43楼 法定代表人:孙树明 电话:020-87556888 网址:www.gf.com.cn	(82) 中信证券股份有限公司 住所:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:张佑君 电话:010-60833888 网址:www.citics.com
(83) 中国银河证券股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人:陈共炎 电话:010-66568888 网址:www.chinastock.com.cn	(84) 海通证券股份有限公司 住所:上海市浦东新区广东路98号 办公地址:上海市浦东新区广东路98号 法定代表人:周杰 电话:021-23211000 网址:www.htsec.com	(85) 申万宏源证券股份有限公司 住所:上海市徐汇区长乐路989号40层 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号40层 法定代表人:李梅 电话:021-33388888 网址:www.swhysc.com
(86) 安信证券股份有限公司 住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层A02单元 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层A02单元 法定代表人:王连志 电话:0755-18282561 网址:www.aixinc.com	(87) 华泰证券股份有限公司 住所:江苏省南京市江东中路228号 办公地址:江苏省南京市江东中路228号 法定代表人:周易 电话:0755-82482193 网址:www.htsec.com	(88) 中信证券股份有限公司 住所:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:张佑君 电话:010-60833888 网址:www.citics.com
(89) 中国中投证券有限责任公司 住所:深圳市福田区益田路5033号中投证券大厦18-21层及深圳市福田区益田路5033号中投证券大厦18-21层 办公地址:深圳市福田区益田路5033号中投证券大厦18-21层及深圳市福田区益田路5033号中投证券大厦18-21层 法定代表人:陈共炎 电话:0755-82482193 网址:www.citics.com	(90) 方正证券股份有限公司 住所:湖南省长沙市芙蓉中路二段华远国际大厦22-24层 办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华远国际大厦22-24层 法定代表人:施华 电话:0731-85878888 网址:www.fund.com.cn	(91) 东方证券股份有限公司 住所:上海市黄浦区中山东路10号东方证券大厦11-17层 办公地址:上海市黄浦区中山东路10号东方证券大厦11-17层 法定代表人:陈如 电话:021-33388888 网址:www.dfzq.com.cn
(92) 方正证券股份有限公司 住所:湖南省长沙市芙蓉中路二段华远国际大厦22-24层 办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华远国际大厦22-24层 法定代表人:施华 电话:0731-85878888 网址:www.fund.com.cn	(93) 长城证券股份有限公司 住所:深圳市福田区深南大道4008号特区报业大厦14、16、17层 办公地址:深圳市福田区深南大道4008号特区报业大厦14、16、17层 法定代表人:丁杰 电话:0755-82517123 网址:www.cgws.com	(94) 光大证券股份有限公司 住所:上海市浦东新区新金桥路1500号 办公地址:上海市浦东新区新金桥路1500号 法定代表人:刘健 电话:021-22166669 网址:www.ebscn.com
(95) 广州证券股份有限公司 住所:广州市天河区珠江新城珠江东路10号广州证券大厦10-12层 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路10号广州证券大厦10-12层 法定代表人:胡伏云 电话:020-88836989 网址:www.gzs.com.cn	(96) 东北证券股份有限公司 住所:吉林省长春市生态大街6666号 办公地址:吉林省长春市生态大街6666号 法定代表人:李福春 电话:0431-85066617 网址:www.nesc.cn	(97) 华安证券股份有限公司 住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 法定代表人:章晓奇 电话:0551-65161622 网址:www.haas.com.cn
(98) 财富证券有限责任公司 住所:湖南长沙芙蓉中路二段80号财富国际金融中心2楼 办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号财富国际金融中心2楼 法定代表人:熊焰 电话:0731-84403347 网址:www.cfzq.com	(99) 申宏源证券股份有限公司 住所:上海市徐汇区长乐路989号40层 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号40层 法定代表人:李梅 电话:021-33388888 网址:www.swhysc.com	(100) 中泰证券股份有限公司 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:021-20315280 网址:www.ztsc.com.cn
(101) 第一创业证券股份有限公司 住所:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 法定代表人:刘学军 电话:0755-23875000 网址:www.firstcapital.com.cn	(102) 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号中航证券大厦41楼 办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号中航证券大厦41楼 法定代表人:王益 电话:0791-86768881 网址:www.avicsec.com	(103) 华福证券有限责任公司 住所:福建省福州市五四路167号新天地大厦7、8层 办公地址:福建省福州市五四路167号新天地大厦7、8层 法定代表人:王益 电话:0591-87393223 网址:www.hfzq.com.cn

(104) 中国国际金融股份有限公司 住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层 法定代表人:陈学军 电话:010-85130223 网址:www.cicc.com.cn	(105) 联讯证券股份有限公司 住所:广东省惠州市惠城区江北东江二路6号广电新闻中心西面一层大堂 办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江二路6号广电新闻中心西面一层大堂 法定代表人:彭国祥 电话:0755-83331106 网址:www.lxsec.com	(106) 英大证券有限责任公司 住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35、36层 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35、36层 法定代表人:姚俊 电话:0755-83331106 网址:www.ydsec.com
(107) 宏信证券股份有限公司 住所:成都市人民南路二段18号川信大厦10楼 办公地址:成都市人民南路二段18号川信大厦10楼 法定代表人:张俊 电话:028-86199278 网址:www.hxsec.com	(108) 中信期货有限公司 住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座1103室、1301室、1306、1307 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座1103室、1301室、1306、1307 法定代表人:张皓 电话:010-60833888 网址:www.citics.com	(109) 东海期货有限责任公司 住所:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号 办公地址:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号 法定代表人:陈杰 电话:021-68757102 网址:www.dhfc.com.cn
(110) 长江证券股份有限公司 住所:湖北省武汉市新华路88号长江证券大厦 办公地址:湖北省武汉市新华路88号长江证券大厦 法定代表人:李勇 电话:027-65656666 网址:www.cjsec.com	(111) 西南证券股份有限公司 住所:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 法定代表人:吴坚 电话:023-63709614 网址:www.swsec.com	(112) 湘财证券股份有限公司 住所:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新湘财金融中心A座11楼 办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新湘财金融中心A座11楼 法定代表人:林俊波 电话:021-38787450 网址:www.xcsc.com
(113) 万联证券股份有限公司 住所:广州市天河区珠江新城华利路27号 办公地址:广州市天河区珠江新城华利路27号 法定代表人:张建军 电话:020-37866700 网址:www.wlzq.com.cn	(114) 民生证券股份有限公司 住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层 办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层 法定代表人:杨明 电话:010-59361276 网址:www.mszq.com	(115) 国元证券股份有限公司 住所:安徽省合肥市寿春路170号 办公地址:安徽省合肥市寿春路170号 法定代表人:蔡咏 电话:0551-2266772 网址:www.gyzq.com.cn
(116) 渤海证券股份有限公司 住所:天津经济技术开发区第一大街74号写字楼101室 办公地址:天津经济技术开发区第一大街74号写字楼101室 法定代表人:王春峰 电话:022-68600608 网址:www.bhsec.com	(117) 山西证券股份有限公司 住所:太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼 办公地址:太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼 法定代表人:侯巍 电话:0351-8686656 网址:www.sxsec.com	(118) 东吴证券股份有限公司 住所:苏州工业园区星阳街5号 办公地址:苏州工业园区星阳街5号 法定代表人:范力 电话:0512-62929229 网址:www.dwzq.com.cn
(119) 信达证券股份有限公司 住所:北京市西城区闹市口大街9号院2号楼 办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院2号楼 法定代表人:高涛 电话:010-63685146 网址:www.cindasc.com	(120) 南京证券股份有限公司 住所:南京市江东中路389号 办公地址:南京市江东中路389号 法定代表人:步国钧 电话:025-84511623 网址:www.njzq.com.cn	(121) 上海证券有限责任公司 住所:上海市四川中路211号上海证券大厦7楼 办公地址:上海市四川中路211号上海证券大厦7楼 法定代表人:李俊杰 电话:021-33088888 网址:www.shsec.com
(122) 新时达证券股份有限公司 住所:北京朝阳区北三环西路99号院15号楼1501 办公地址:北京朝阳区北三环西路99号院15号楼1501 法定代表人:李永芳 电话:010-63961463 网址:www.xdsd.com.cn	(123) 大同证券有限责任公司 住所:大同市城区迎宾街15号鹏城时代21层 办公地址:大同市城区迎宾街15号鹏城时代21层 法定代表人:薛峰 电话:0351-4130322 网址:www.dtsd.com.cn	(124) 国联证券股份有限公司 住所:无锡市金融一街8号 办公地址:无锡市金融一街8号 法定代表人:姚志洪 电话:0510-82231662 网址:www.glsc.com.cn
(125) 浙商证券股份有限公司 住所:浙江省杭州市庆元路1号浙商证券大厦6-7楼 办公地址:浙江省杭州市庆元路1号浙商证券大厦6-7楼 法定代表人:陈立东 电话:0571-87901012 网址:www.zhsd.com.cn	(126) 平安证券股份有限公司 住所:深圳市福田区金田路4008号平安大厦16-20层 办公地址:深圳市福田区金田路4008号平安大厦16-20层 法定代表人:刘雯 电话:021-38624366 网址:www.pingan.com	(127) 东莞证券股份有限公司 住所:东莞市莞城区运河路9号金融中心30楼 办公地址:东莞市莞城区运河路9号金融中心30楼 法定代表人:张永强 电话:0769-22119712 网址:www.dgzq.com.cn

(128) 中原证券股份有限公司 住所:郑州市郑东新区商务外环10号 办公地址:郑州市郑东新区商务外环10号 法定代表人:菅爱军 电话:0371-69090082 网址:www.zysec.com	(129) 国都证券股份有限公司 住所:北京东城区东直门内大街6号国都证券大厦10层 办公地址:北京东城区东直门内大街6号国都证券大厦10层 法定代表人:李春生 电话:010-94153389 网址:www.gdsc.com.cn	(130) 东海证券股份有限公司 住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场14楼 办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场14楼 法定代表人:赵松 电话:021-86133333 网址:www.dhsec.com
(131) 中国银河证券股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人:陈共炎 电话:010-66568888 网址:www.chinastock.com.cn	(132) 恒泰证券股份有限公司 住所:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方广场A座光大银行办公楼14-18层 办公地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方广场A座光大银行办公楼14-18层 法定代表人:孟介林 电话:0471-4972675 网址:www.hhtsec.com	(133) 国盛证券有限责任公司 住所:江西省南昌市北京西路88号 办公地址:江西省南昌市北京西路88号 法定代表人:李峰 电话:0791-86281306 网址:www.gssec.com
(134) 金元证券股份有限公司 住所:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层 办公地址:海口市南宝路36号证券大厦4层 法定代表人:王作乐 电话:0755-83065022 网址:www.jysec.com	(135) 德邦证券股份有限公司 住所:上海市普陀区曹杨路510号南幢8楼 办公地址:上海市普陀区曹杨路510号南幢8楼 法定代表人:武志福 电话:021-68757102 网址:www.dbsec.com	(136) 华龙证券股份有限公司 住所:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心 办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心 法定代表人:李春生 电话:0931-4890208 网址:www.hlzq.com
(137) 财通证券股份有限公司 住所:杭州市西湖区转塘13号嘉华国际商务中心 办公地址:浙江省杭州市西湖区转塘13号嘉华国际商务中心 法定代表人:孙建 电话:0571-87789160 网址:www.ctsec.com	(138) 上海华信证券有限责任公司 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心10楼 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心10楼 法定代表人:薛峰 电话:021-39298817 网址:www.shhxzq.com	(139) 华鑫证券有限责任公司 住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01和B1单元 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01和B1单元 法定代表人:薛峰 电话:021-64672622 网址:www.huaxinsec.com
(140) 瑞银证券有限责任公司 住所:北京市西城区金融大街7号瑞银国际金融中心12、15层 办公地址:北京市西城区金融大街7号瑞银国际金融中心12、15层 法定代表人:钱于军 电话:010-15628112 网址:www.ubssecurities.com	(141) 中汇证券有限责任公司 住所:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座18、19层 办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座18、19层 法定代表人:黄伟强 电话:0755-32570586 网址:www.zhonghui.com	(142) 国融证券股份有限公司 住所:呼和浩特市新城区新华大街108号 办公地址:呼和浩特市新城区新华大街108号 法定代表人:张朝 电话:0471-69099177 网址:www.gryzq.com
(143) 江海证券有限公司 住所:哈尔滨市香坊区长江路333号 办公地址:哈尔滨市香坊区长江路333号 法定代表人:陈强 电话:0451-68862726 网址:www.jhzq.com.cn	(144) 国金证券股份有限公司 住所:四川省成都市青羊区东城根上街95号 办公地址:四川省成都市青羊区东城根上街95号 法定代表人:冉云 电话:028-86606007 网址:www.gjzq.com.cn	(145) 中国民族证券有限责任公司 住所:北京市朝阳区朝阳门内大街100号 办公地址:北京市朝阳区朝阳门内大街100号 法定代表人:李春生 电话:010-63961463 网址:www.mzsec.com
(146) 华宝证券有限责任公司 住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心C57层 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心C57层 法定代表人:陈林 电话:021-68777222 网址:www.huabao.com.cn	(147) 长城国瑞证券有限公司 住所:厦门市思明区厦港路17号 办公地址:厦门市思明区厦港路17号 法定代表人:王勇 电话:0592-23972929 网址:www.cgrsec.com	(148) 爱建证券有限责任公司 住所:上海市浦东新区世纪大道1609号32楼(陆家嘴商务广场) 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1609号32楼(陆家嘴商务广场) 法定代表人:倪蔚 电话:021-32228888 网址:www.ajzq.com
(149) 华融证券股份有限公司 住所:北京市西城区金融大街10号 办公地址:北京市西城区金融大街10号 法定代表人:宋广文 电话:010-58561000 网址:www.hrsec.com.cn	(150) 天风证券股份有限公司 住所:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼 办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼 法定代表人:余磊 电话:027-87610717 网址:www.tfzq.com	(151) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006 办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006 法定代表人:马勇 电话:010-83363011 网址:www.xinland.com.cn
(152) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室 办公地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室 法定代表人:陈柏青 电话:021-60897940 网址:www.fund123.cn	(153) 北京汇成基金销售有限公司 住所:北京市西城区阜成门内大街11号1110室 办公地址:北京市西城区阜成门内大街11号1110室 法定代表人:李博 电话:010-56264240 网址:www.hcfund.com	(154) 北京新浪仓石基金销售有限公司 住所:北京市海淀区中关村大街11号1110室 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号1110室 法定代表人:李博 电话:010-56264240 网址:www.sinafund.com

北京新华富石基金销售有限公司

北京市丰台区北四环中路68号理想国际大厦A座906室

北京市丰台区北四环中路68号理想国际大厦A座906室

联系人 付文廷

电话 010-63767635 传真 010-62870882

http://www.xinhafu.com 客服电话 010-62870883

(156) 上海万得基金销售有限公司

中国(上海)自由贸易试验区峨山路33号11楼B09室

中国(上海)自由贸易试验区峨山路33号11楼B09室

法定代表人 王廷富

联系人 姜吉列

电话 021-68882281 传真 021-68882281

网址 http://www.wendfund.com 客服电话 400-821-0203

(156) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

宁夏银川市金凤区阅海中央商务区万寿路142号4层406号

宁夏银川市金凤区阅海中央商务区万寿路142号4层406号

法定代表人 邢琳

联系人 郭煜

电话 010-56160168 传真 010-56160173

http://www.fenghuangx.com 客服电话 400-810-55919

(157) 北京肯瑞瑞财富管理服务有限公司

北京市海淀区中关村东路60号1号楼2层2203-006

北京市海淀区中关村东路60号1号楼2层2203-006

法定代表人 江涛

联系人 江涛

电话 4000888511 传真 010-58172800

网址 www.kennedy.com.cn 客服电话 400-088-8816

(158) 北京蛋卷基金销售有限公司

北京市朝阳区阜通东大街1号院1号楼9层22122627

北京市朝阳区阜通东大街1号院1号楼9层22122627

法定代表人 钟思坚

联系人 袁永秋

电话 010-61940688 传真 010-61940699

http://www.danjuan.com 客服电话 4000-618-618

(三)基金注册登记机构

嘉实基金管理有限公司(同上)

(三)律师事务所和独立注册会计师

名称 上海市锦天城律师事务所

住所 上海市浦东新区世纪大道1500号10楼

办公地址 上海市浦东新区世纪大道1500号10楼

法定代表人 姚文平

联系人 黎明

电话 021-31336666 传真 021-31336866

经办律师 白虹、黎明

(四)会计师事务所和独立注册会计师

名称 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人 李丹

联系人 张勇

电话 021-23238888 传真 021-23238890

经办注册会计师 薛焱、张勇

四、基金名称

嘉实安心货币市场基金

五、基金类型

货币市场基金;契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:在有效控制投资组合风险和保持较高流动性为优先目标,力求获得高于业绩比较基准的收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许基金投资的金融工具,包括:现金;期限在一年以内(含一年)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;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。

如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,基金管理人可根据法律法规或监管机构的相关规定,将其纳入本基金投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

1. 整体资产配置策略

根据宏观经济指标(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业水平、国际间利率水平、汇率等),决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布。

2. 类别资产配置策略

根据整体策略要求,决定组合中各类资产的投资内容和各类资产的比例。

根据不同类型的资产的流动性指标(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、近期溢价率、交易所等),决定类别资产的当期配置比例。

根据不同类型的资产的收益率水平(持有期收益率、到期收益率、票面利率、利息支付水平、利息税税率等),决定组合中各类资产的投资比例。

根据各类资产的信用等级及担保状况,决定组合的信用风险。

3. 目标资产配置策略

第一步筛选,根据目标资产的剩余期限、信用等级、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,根据个别资产的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税税率)与剩余期限的对比,对组合中各类资产的投资比例进行初步筛选。

第三步筛选,根据个别资产的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间),决定投资比例。

(二)投资决策

1) 决策依据

(1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

(2) 宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行状况,货币市场和证券市场运行状况。

2) 决策程序

1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和市场的判断决定基金投资的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析,提出分析报告。

3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究报告提出的报告,并依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定具体资产配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。

4) 交易部依据基金投资的指令,制定交易策略并执行交易。

5) 监察稽核部负责基金投资的运作管理是否符合法律法规及基金合同和基金合同相关管理制度的规定;风险管理部运用风险量模型以及各种风险监控指标,对市场利率风险进行实时监控,对基金组合的风险进行评估,及时发现风险监控;风险控制委员会根据市场情况对基金投资组合进行风险评估与监控。

九、基金的业绩比较基准

本基金为货币市场基金,七天通知存款利率(税后)

十、基金的风险收益特征

本基金属于货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,本基金的风险预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

十一、基金管理人承诺

基金管理人及基金托管人承诺基金管理人不存在虚假记载、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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2018年7月16日为本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容,保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告数据截至2018年6月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

一、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	1,300,001,566.78	38.11
	其中:债券	1,300,001,566.78	38.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	800,000,170.00	22.72
3	银行存款和结算备付金及其他货币资金	943,437,161.26	26.69
4	其他资产	42,379,013.19	1.49
5	合计	2,886,317,900.23	100.00

二、报告期末投资组合资产配置情况

报告期内本基金基金资产净值变动情况,报告期末本基金每日(债券)回购金额未超过基金资产净值的20%。

三、基金投资组合平均存续期限分析

(一)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	63
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	26

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过75天。

(二)报告期末投资组合平均剩余期限分析表

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	67.81	6.86
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天<=期限<=60天	22.67	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天<=期限<=90天	6.29	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天<=期限<=120天	0.74	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天<=期限<=397天	18.88	-
	其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债	-	-
合计	100.28	6.86	-

四、报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过240天。

五、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	89,071,064.11	3.32
2	央行票据	-	-
3	金融债	150,019,423.20	5.56
4	其中:政策性金融债	150,019,423.20	5.56
5	企业债	-	-
6	企业短期融资券	170,028,712.21	6.29
7	中期票据	60,013,437.03	2.22
8	同业存单	629,971,081.00	23.21
9	合计	1,300,001,566.78	40.69
	持仓成本超过397天的浮动利率债	-	-

注:上表,附息债券的成本包括债券面值加上溢价,贴现债券的成本包括按成本折价在日内收取利息。

六、报告期末按摊余成本法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	持仓数量(张)	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1718207	17国开07	1,000,000	100,001,472.80	3.70
2	011800660	18国开03(CP001)	1,000,000	99,895,729.94	3.70