

# 东方红货币市场基金招募说明书(更新)(摘要)

(2018年第2号)

办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人:薛峰

联系电话:0755-33227950

传真:0755-82087938

联系人:董彩平

客服电话:4006788887

公司网站:www.zfund.cn

(10) 招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:李建红

联系电话:(0755)83198888

联系人:李海婧

客服电话:95555

公司网站:www.cmbchina.com

(11) 中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人:李晓鹏

联系电话:010-63636235

传真:010-63636713

联系人:张清

客服电话:95556

公司网站:www.cebbank.com

(12) 中国建设银行

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区金融大街25号

法定代表人:田国立

联系人:徐雯霞

电话:86-10-66215533

传真:010-66275654

客服电话:95533

公司网站:www.ccb.com

(13) 平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人:谢永林

联系电话:021-38637673

联系人:张莉

客服电话:95511

公司网站:www.bank.pingan.com

(14) 长江证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市新华路特号

办公地址:湖北省武汉市新华路特号

法定代表人:尤习贵

联系人:吴鹏

客服电话:027-65799999

传真:027-85481900

客服电话:95579

公司网站:www.95579.com

(15) 华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市江东中路228号

办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4111号中旅大厦18楼

法定代表人:周易

联系人:张宇明

联系电话:025-83387249

传真:025- 83387254

客服电话:95507

公司网站:www.htsc.com.cn

(16) 上海东证期货有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路500号上海期货大厦14层

办公地址:上海市黄浦区中山南路318号35层

法定代表人:卢大印

联系人:张敬凯

联系电话:021-63258988-4259

传真:021-63267252

客服电话:400-885-9999

网站:www.dzqh.com.cn

(17) 中泰证券股份有限公司

注册地址: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

传真:0531-68893937

客服电话:95538

网站:www.ztsc.com.cn

(18) 交通银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路188号

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:彭纯

联系电话:021-58781234

传真:021-58408483

联系人:陈路琦

客服电话:95559

公司网站:www.bankcomm.com

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。

(二) 登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话:010-58598853

传真:010-58598907

联系人:赵齐芳

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人:俞卫锋

电话:(021)31258666

传真:(021)31258600

联系人:陈颖华

经办律师:孙睿、陈颖华

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展银银行大厦507单元01室

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

法定代表人:李丹

经办注册会计师:薛岚、陈熾

电话:021-23238800

传真:021-23238800

联系人:吴翼

客服电话:4007009665

公司网站:www.ehowbuy.com

(4) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人:肖雯

联系电话:020-89629099

传真:020-89629011

联系人:黄轶虹

客户服务电话:020-89629066

网站:www.yingmicm.com

(5) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民生大厦6层

法定代表人:闫振杰

联系人:李海婧

电话:010-59601366-7024

传真:010-62002055

邮政编码:100029

客户服务电话:4008188000

公司网站:www.yfund.com

(6) 东方财富证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元

办公地址:上海市虹口区虬江路369号9层3724室

法定代表人:汪静波

办公地址:上海市静安区曲阜路32号东码头园区C栋

法定代表人:汪静波

联系人:朱了

电话:86-21-80358749

传真:021-38509777

客服电话:400-400-5219

公司网站:www.noah-fund.com

(8) 嘉实财富管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元

办公地址:上海市虹口区虬江路369号9层3724室

法定代表人:赵学军

联系电话:021-38789658-5834

传真:021-68820023

联系人:王晋

客服电话:4000218850

网站:www.harvestwm.cn

(9) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

根据回购市场利率走势变化情况,在回购利率较低时,正回购

质押,融资后再投资于短期债券,由此提高基金收益水平。

另一方面,把握收益率倒挂的短线机会,如在新股发行、年末资金回笼时期的季节效应,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率提升的投资机会。

6. 流动性管理策略

本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过现金库存管理、回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保证本基金资产充分流动性的基础上,获取较高收益。

7. 资产支持证券的投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主,仍处于初级阶段,因而对于资产支持证券的投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,评估其投资价值及风险,选择对价值较高的资产支持证券进行分散投资,以降低流动性风险,获得稳定收益。

九. 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:当期银行活期存款利率(税后)

本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始执行。

如果今后法律法规发生变化,或者有其他更具代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十. 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

十一. 基金的投资组合报告

以下投资组合报告数据截至2018年6月30日。

1. 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	490,179,040.87	30.03
	其中:债券	490,179,040.87	30.03
2	买入返售金融资产	640,792,982.13	39.01
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	625,209,066.03	38.57
4	其他资产	8,407,219.98	0.52
5	合计	1,612,638,298.98	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2. 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.01
	其中:买断式回购融资	-
2	报告期末债券回购融资余额	2.08
	其中:买断式回购融资	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为本报告期内每个交易日融资余额占资产净值的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

(2) 报告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(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	90天以内	49.07	2.98
	其中:剩余存续期超过90天的浮动利率资产	-	-
2	90天-40天	20.06	-
	其中:剩余存续期超过90天的浮动利率资产	-	-
3	60天-90天	22.02	-
	其中:剩余存续期超过90天的浮动利率资产	-	-
4	90天-120天	3.19	-
	其中:剩余存续期超过90天的浮动利率资产	-	-
5	120天-397天(含)	6.37	-
	其中:剩余存续期超过90天的浮动利率资产	-	-
合计		100.01	2.98

4. 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	央行票据	-	-
2	央行票据	-	-
3	国债	100,170,192.79	6.40
	其中:政策性金融债	100,170,192.79	6.40
4	金融债	90,021,581.92	5.76
5	中期票据	307,987,175.98	19.68
6	短期融资券	490,179,948.07	31.03
7	合计	490,179,948.07	31.03

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10名债券投资组合

序号	债券代码	债券简称	债券规模(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	180201	18国债01	700,000	70,190,010.66	4.49
2	11178902	17国债07	500,000	49,899,294.75	3.10
3	07180014	08国债(国)01	300,000	30,014,650.88	1.92
4	11181817	18国债07	300,000	29,751,197.00	1.90
5	11180164	18国债07	300,000	29,710,062.96	1.90
6	07180013	08国债(国)02	200,000	20,000,730.97	1.28
7	170410	17国债04	200,000	19,994,681.23	1.26
8	11181810	18国债07	200,000	19,994,363.16	1.26
9	11181028	18国债07	200,000	19,978,206.28	1.27
10	11180516	18国债07	200,000	19,854,115.02	1.27

7. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

偏离情况	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的绝对值在0.5%-1%间的次数	0.027%
报告期内偏离度的绝对值超过1%的次数	-0.061%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.000%

8. 报告期内正偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

9. 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

10. 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9. 投资组合报告附注

(1) 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按实际利率法每日计提收益。

(2) 本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制前一年內受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金持有的18国债发行CD238(代码:11181023)发行主体兴业银行股份有限公司(以下简称“公司”),因公司存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等十二项违法违规行为,被银保监会于2018年4月19日对公司作出行政处罚决定(银保监罚决字〔2018〕11号),处以1587.0万元罚款。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定,本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余九名证券的发行主体在期末未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年內受到公开谴责、处罚的情形。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收利息	-
2	应收证券清算款	24,030.02
3	应收股利	5,638,688.61
4	应收申购款	2,746,459.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	预付款项	-
8	存货	8,407,219.98

(4) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一. 基金的业绩

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。投资有风险,投资人在做出