(上接B059版)

| | | |
|---|---|---|
| 121 | 海银基金销售有限公司 | 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室<br>办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼<br>法定代表人:刘惠<br>联系人:刘辉<br>电话:021-60206991<br>传真:021-60133413<br>客服电话:400-808-1016<br>网址:www.fundhaiyin.com |
| 122 | 北京植信基金销售有限公司 | 注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-47<br>办公地址:北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼<br>法定代表人:于龙<br>联系人:吴鹏<br>电话:010-56076718<br>传真:010-67767615<br>客服电话:4006-802-123<br>网址:http://www.zhixin-inv.com |
| 123 | 大智慧基金销售有限公司 | 注册地址:上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层<br>办公地址:上海浦东杨高南路428路1号楼10-11层<br>法定代表人:申建<br>联系人:印强明<br>电话:021-20219536<br>传真:021-20219023<br>客服电话:021-20219931<br>网址:http://www.wg.com.cn |
| 124 | 上海联泰资产管理有限公司 | 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室<br>办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层<br>法定代表人:燕斌<br>联系人:陈东<br>电话:021-52822063<br>传真:021-62075270<br>客服电话:400-166-6788<br>网址:http://www.66zichan.com |
| 125 | 上海利得基金销售有限公司 | 注册地址:上海市宝山区富川路475号1033室<br>办公地址:上海浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦<br>法定代表人:李兴春<br>联系人:郑茂<br>电话:021-50820533<br>传真:021-60196218<br>客服电话:400-021-7755<br>网址:www.leadfund.com.cn |
| 126 | 上海汇付金融服务有限公司 | 注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层<br>上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼<br>法定代表人:金佶<br>联系人:陈云卉<br>电话:021-33323999<br>传真:021-33323837<br>客服电话:400-821-3999<br>网址:http://ttychinapnr.com |
| 127 | 厦门市鼎鼎盛控股有限公司 | 注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504<br>办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504<br>法定代表人:陈晓生<br>联系人:梁云波<br>电话:0592-3122757<br>传真:0592-3122701<br>客服电话:400-918-0808<br>网址:www.xdfa.com.cn |
| 128 | 上海陆金所基金销售有限公司 | 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼00单元<br>办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼<br>法定代表人:胡学勤<br>联系人:宁博宇<br>电话:021-20689652<br>传真:021-22066653<br>客服电话:4008219031<br>网址:www.lufunds.com |
| 129 | 北京加和基金销售有限公司 | 注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层<br>办公地址:北京市西城区金融街11号703<br>法定代表人:徐福贺<br>联系人:张鹏<br>电话:010-5086 6176<br>传真:010-5086 6173<br>客服电话:400-600-0030<br>网址:www.hzfunds.com |
| 130 | 北京虹点基金销售有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室<br>办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座昆仑饭店楼二层<br>法定代表人:胡伟<br>联系人:陈欣雨<br>电话:18513688505<br>客服电话:400-068-1176<br>网址:www.hongdianfund.com |
| 131 | 北京新浪仓石基金销售有限公司 | 注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期西扩N-1、N-2地块新浪总部科研楼G层101室<br>办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期西扩N-1、N-2地块新浪总部科研楼G层101室<br>法定代表人:李彤阳<br>联系人:吴爽<br>电话:010-60619607<br>客服电话:010-62675369<br>网址:http://www.xincai.com |
| 132 | 珠海盈米财富管理有限公司 | 注册地址:珠海市横琴新区宁波路8号106室-3491<br>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1201-1203室<br>法定代表人:肖雯<br>联系人:邱鹏鹏<br>电话:020-89629099<br>传真:020-89629011<br>客服电话:020-89629066<br>网址:www.yingmi.cn |
| 133 | 深圳富济基金销售有限公司 | 注册地址:深圳市福田区福田街道金田路4018号安联大厦35层01B、02、03、04单位<br>办公地址:深圳市福田区福田街道金田路4018号安联大厦35层01B、02、03、04单位<br>法定代表人:刘鹏宇联系人:刘鹏<br>电话:0755-83999907-811<br>传真:0755-83999926<br>客服电话:0755-83999907<br>网址:www.jrjagent.com |
| 134 | 北京唐鼎耀华基金销售有限公司 | 注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百家湾10号2栋236室<br>办公地址:北京朝阳区光华路甲8号二十一世纪大厦A座303<br>法定代表人:张鑫<br>联系人:刘亮楠<br>电话:010-53670572/13121820670<br>传真:010-68200800<br>客服电话:400-819-9868<br>网址:http://www.tdyhfund.com/ |
| 135 | 上海凯石财富基金销售有限公司 | 注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室<br>办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼<br>法定代表人:陈继武<br>联系人:黄玲<br>电话:021-63333389-230<br>传真:021-63333390<br>客服电话:4006-433-389<br>网址:www.vstonewealth.com |
| 136 | 大泰金石基金销售有限公司 | 注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室<br>办公地址:上海市浦东新区杨高南路536号东方鸿一大厦15楼<br>法定代表人:袁顺平<br>联系人:孟召玲<br>电话:15621506619<br>传真:021-20324199<br>客服电话:400-928-2296/021-22267995<br>网址:www.dtfunds.com |
| 137 | 济安财富(北京)基金销售有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室<br>办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层<br>法定代表人:杨健<br>联系人:李海燕<br>电话:15622106516<br>传真:010-65230699<br>客服电话:400-673-7010<br>网址:http://www.jaafortune.com |
| 138 | 中证金牛(北京)投资咨询有限公司 | 注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-46室<br>办公地址:北京市西城区宣武门"四大街甲1号新华社第三工作区5F<br>法定代表人:钱昊旻<br>联系人:孙爱<br>电话:010-59336519<br>传真:010-59336500<br>客服电话:4008-909-998<br>网址:www.jrjc.com |
| 139 | 鼎信汇金(北京)投资管理有限公司 | 注册地址:北京市海淀区太月园3号楼5层221室<br>办公地址:北京市海淀区太月园3号楼5层221室<br>法定代表人:齐凌峰<br>联系人:阮志凌<br>电话:010-83006520<br>传真:010-83286110<br>客服电话:400-158-5050<br>网址:www.5hfund.com |
| 140 | 北京汇成基金销售有限公司 | 注册地址:北京市海淀区中关村大街11号1108<br>办公地址:北京市海淀区中关村大街11号1108<br>法定代表人:王伟刚<br>联系人:丁向坤<br>电话:010-56282140<br>传真:010-62630627<br>客服电话:4006190059<br>网址:www.hcjj.com.cn |
| 141 | 南京苏宁基金销售有限公司 | 注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号<br>办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号<br>法定代表人:钱燕飞<br>联系人:王锋<br>电话:025-66996699-887226<br>传真:025-66996699<br>客服电话:95177<br>网址:www.snjrj.jin.com |
| 142 | 北京广源达投资管理有限公司 | 注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层606室<br>办公地址:北京市朝阳区望京东园四区酒顶中心B座15层<br>法定代表人:齐刚辉<br>联系人:姜英华<br>电话:4006236060<br>传真:010-82066860<br>客服电话:4006236060<br>网址:www.niuniufund.com |
| 143 | 上海万得基金销售有限公司 | 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区临港路333号14楼08座<br>办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼<br>法定代表人:于廷宣<br>联系人:徐丽丹<br>电话:021-60712782<br>传真:021-60710161<br>客服电话:400-821-0203 |
| 144 | 北京蛋卷基金销售有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区草場东大街1号院6号楼2单元21层222507<br>办公地址:北京市朝阳区草場东大街1号院6号楼2单元21层222507<br>法定代表人:钟斐斐<br>联系人:吴李林<br>电话:010-61840688<br>传真:010-61840699<br>客服电话:4000618518<br>网址:https://www.danjuanapp.com |
| 145 | 上海云湾基金销售有限公司 | 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层<br>办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层<br>法定代表人:戴新铭<br>联系人:江辉<br>电话:021-20638998<br>传真:021-20638999<br>客服电话:400-820-1515<br>网址:www.zhengtongfunds.com |
| 146 | 上海中正达广基金销售有限公司 | 注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室<br>办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室<br>法定代表人:黄铁辰名人:戴凯隆<br>电话:021-33788132<br>传真:021-33788132-802<br>客服电话:400-6767-523<br>网址:www.zhongzhengfund.com |
| 147 | 南京途牛金融信息服务有限公司 | 注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号<br>办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号<br>法定代表人:宋时歌<br>联系人:贺杰<br>电话:025-86853969-67727<br>传真:025-86853969<br>客服电话:4007-999-999<br>网址:http://jr.tuniu.com |
| 148 | 上海基煜基金销售有限公司 | 注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)<br>办公地址:上海市花园路518号北美广场A栋1002-1003室<br>法定代表人:王福跃联系人:蓝杰<br>电话:021-23289523<br>传真:021-65085991<br>客服电话:400-820-5369<br>网址:www.jiyufund.com.cn |
| 149 | 深圳市金斧子基金销售有限公司 | 注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层<br>办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元7层<br>法定代表人:赖任军联系人:刘莉霞<br>电话:0755-29330613<br>传真:0755-26920530<br>客服电话:400-030-0660<br>网址:www.jfzinv.com |
| 150 | 北京肯特瑞财富投资管理有限公司 | 注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2602-06<br>办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层<br>法定代表人:江卉<br>联系人:徐衍宇<br>电话:010-89188356<br>传真:010-89188666<br>客服电话:95118<br>网址:jr.jd.com |
| 151 | 上海华夏财富投资管理有限公司 | 注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼2208室<br>办公地址:北京市西城区金融大街35号圣泰大厦9层8层<br>法定代表人:毛亚平<br>联系人:仲秋玥<br>电话:010-88066632<br>传真:010-88066552<br>客服电话:400-817-5666<br>网址:www.amcfortune.com |
| 152 | 大同财富基金销售有限公司 | 注册地址:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1楼20层12号<br>办公地址:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1楼20层12号<br>法定代表人:王筑联系人:潘建<br>电话:0851-88425605<br>传真:0851-88425602<br>客服电话:0851-88235678<br>网址:www.uniinf.com |
| 153 | 通华财富(上海)基金销售有限公司 | 注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室<br>办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号5号楼9楼<br>法定代表人:马刚<br>联系人:杨欲霞<br>电话:021-60818187<br>传真:021-60818187<br>客服电话:95156<br>网址:https://www.tonghuafund.com |
| 154 | 上海挖财基金销售有限公司 | 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区高南路799号5层01、02、03室<br>办公地址:中国(上海)自由贸易试验区高南路799号5层01、02、03室<br>法定代表人:胡燕亮<br>联系人:李娟<br>电话:021-50810687<br>传真:021-58300279<br>客户服务电话:021-50810673<br>网址:www.wacaijijin.com |
| 155 | 和耕传承基金销售有限公司 | 注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间<br>办公地址:郑州市郑东新区东风南路绿宁街互联网金融大厦602室<br>法定代表人:李夏慧联系人:胡静华<br>电话:0371-85518336<br>传真:0371-85518397<br>客服电话:4000-555-671<br>网址:www.hgcrph.com/ |
| 156 | 大连网金金融信息服务有限公司 | 注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室<br>办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室<br>法定代表人:卜勇<br>客服电话:4000-899-100<br>网址:http://p.hexun.com/ |
| 157 | 一路财富(北京)信息科技股份有限公司 | 注册地址:北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208<br>办公地址:北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208<br>法定代表人:吴雪秀<br>联系人:徐磊<br>电话:18510640608<br>客服电话:400-001-1566<br>网址:www.yilucaifu.com |
| 158 | 北京恒宇天泽基金销售有限公司 | 注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2602-06<br>办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东总部A座17层<br>法定代表人:江卉<br>联系人:徐衍宇<br>电话:010-89188356<br>传真:010-89188666<br>客服电话:95118<br>网址:jr.jd.com |
| 159 | 上海华夏财富投资管理有限公司 | 注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼2208室<br>办公地址:北京市西城区金融大街35号圣泰大厦9层8层<br>法定代表人:毛亚平<br>联系人:仲秋玥<br>电话:010-88066632<br>传真:010-88066552<br>客服电话:400-817-5666<br>网址:www.amcfortune.com |
| 160 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告 | |

南方现金E代销机构:

| 序号 | 代销机构名称 | 代销机构信息 |
|---|---|---|
| 1 | 中信证券股份有限公司 | 注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座<br>办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦<br>法定代表人:张佑君<br>联系人:邓慧<br>电话:010-60838888<br>传真:010-60833739<br>客服电话:95588<br>网址:www.citicsinfo.com |
| 2 | 中信证券(山东)有限责任公司 | 注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼30层<br>办公地址:山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层<br>法定代表人:姜晓林<br>联系人:邓慧明<br>联系电话:0531-89606166<br>客服电话:95548<br>网址:www.zcxzq.com.cn |
| 3 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告 | |

南方现金F代销机构:

| 序号 | 代销机构名称 | 代销机构信息 |
|---|---|---|
| 1 | 上海陆金所基金销售有限公司 | 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼00单元<br>办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼<br>法定代表人:胡学勤<br>联系人:宁博宇<br>电话:021-20656952<br>传真:021-22066653<br>客服电话:4008219031<br>网址:www.lufunds.com |
| 2 | 本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告 | |

3.2 登记机构

南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人:张海波

电话:(0755)82763849

传真:(0755)82763889

联系人:古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所

广东华瀚律师事务所

注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路1002号宝安广场A座16楼G.H室

负责人:李兆良

电话:(0755)82687860

传真:(0755)82687861

经办律师:杨忠、戴瑞冬

3.4 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)

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:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系人:曹阳

联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:薛竞、曹阳

§4 基金名称

南方现金增利基金

§5 基金的类型

契约型开放式

§6 基金的投资目标

本基金为具有高流动性、低风险和稳定收益的货币市场基金,在控制风险的前提下,力争为投资者提供稳定的收益。

§7 基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,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。

§8 基金的投资策略

本基金资产配置的目标是充分满足流动性的基础上考虑稳定的投资收益。本基金的战略资产配置部分,主要包括市场利率预期、基金组合平均剩余期限水平等由投资决策委员会根据宏观经济情况及未来资金面的判断决定。本基金的战术资产配置部分,主要包括交易市场和投资品种选择、关键时期的时机选择、回购套利、选择价格低估的央行票据和短债等将由基金经理根据当时的市场情况,市场环境变化,充分利用分析研究资源和金融工程技术调整资产配置比例,以期达到优化配置效果。

§9 基金业绩比较基准

本基金基准收益率=同期7天通知存款利率(税后)。

§10 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

§11 基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日(未经审计)。

1.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 38,463,227,513.28 | 50.59 |
| | 其中:债券 | 37,147,243,513.28 | 48.86 |
| | 资产支持证券 | 1,315,984,000.00 | 1.73 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 9,518,517,077.46 | 12.52 |
| | 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 | 27,300,799,446.23 | 35.91 |
| 4 | 其他资产 | 742,848,045.64 | 0.98 |
| 5 | 合计 | 76,025,392,081.58 | 100.00 |

1.2 报告期债券回购融资情况

| 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 | 4.02 |
| | 其中:买断式回购融资 | - |
| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 500,084,000.87 | 0.67 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

1.3 基金投资组合平均剩余期限

1.3.1 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 | 87 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 87 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 60 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过240天的说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

1.3.2 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(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 20.54 | 1.06 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.59 | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 14.19 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 37.98 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—120天 | 7.09 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 20.86 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 100.66 | 1.06 |

1.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

1.5 报告期末投债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 1,566,853,594.45 | 2.07 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,321,468,331.78 | 4.42 |
| | 其中:政策性金融债 | 3,321,468,331.78 | 4.42 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 2,076,279,419.99 | 2.77 |
| 6 | 中期票据 | 70,066,720.63 | 0.09 |
| 7 | 同业存单 | 30,122,575,446.40 | 40.12 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 37,147,243,513.25 | 49.47 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 439,412,122.25 | 0.59 |

1.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1171703217 | 17广州农村商业银行CD151 | 15,000,000 | 1,490,784,962.75 | 1.99 |
| 2 | 1171711587 | 17徽商银行CD117 | 13,000,000 | 1,296,630,749.12 | 1.73 |
| 3 | 1118091172 | 18浦发银行CD172 | 10,000,000 | 991,976,063.60 | 1.32 |
| 4 | 1118156075 | 18民生银行CD075 | 10,000,000 | 991,721,723.98 | 1.32 |
| 5 | 1118210083 | 18渤海银行CD083 | 10,000,000 | 990,581,154.67 | 1.32 |
| 6 | 1118197222 | 18临京银行CD233 | 10,000,000 | 989,887,245.62 | 1.32 |
| 7 | 1118091193 | 18南发银行CD193 | 10,000,000 | 979,367,786.76 | 1.30 |
| 8 | 1118200071 | 18广发银行CD071 | 10,000,000 | 978,112,419.94 | 1.30 |
| 9 | 1118156263 | 18民生银行CD263 | 8,000,000 | 793,368,775.03 | 1.06 |
| 10 | 1118110070 | 18平安银行CD070 | 8,000,000 | 792,818,132.37 | 1.06 |

1.7 "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 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1270% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0214% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0621% |

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

1.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 摊余成本(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 149418 | 宁沪03A2 | 2,900,000 | 290,000,000.00 | 0.39 |
| 2 | 149419 | 宁沪03A3 | 2,500,000 | 250,000,000.00 | 0.33 |
| 3 | 149563 | 宁沪04A1 | 2,400,000 | 240,000,000.00 | 0.32 |
| 4 | 149564 | 宁沪04A2 | 2,000,000 | 200,000,000.00 | 0.27 |
| 5 | 149417 | 宁沪03A1 | 1,700,000 | 170,000,000.00 | 0.23 |
| 6 | 149294 | 宁沪02A1 | 1,500,000 | 150,000,000.00 | 0.20 |
| 7 | 1789189 | 17永进2A | 600,000 | 15,984,000.00 | 0.02 |

1.9 投资组合投资指数法

1.9.1 基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即以什对象以买入成本列示,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,每日计提收益。

1.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体除17广发银行CD071(111820071)以外,本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。2017年11月17日,中国银监会对广发银行股份有限公司出具与事实不符的金融票证、未尽职审查保理业务贸易背景真实性等多项违规行为进行处罚,包括警告、没收违法所得17553.79万元,并处3倍罚款5266.37万元,对其他违规行为罚款2000万元,罚没合计72215.16万元。基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

1.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 300,000,000.00 |
| 3 | 应收利息 | 364,660,694.39 |
| 4 | 应收申购款 | 176,670,031.25 |
| 5 | 其他应收款 | 1,527,320.00 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 742,848,045.64 |

§12 基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

A级

| 阶段 | 份额净值收益率(1) | 份额净值收益率标准差(2) | 业绩比较基准收益率(3) | 业绩比较基准收益率标准差(4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2004.3.5-2004.12.31 | 2.26% | 0.16% | 1.32% | 0.00% | 0.94% | 0.16% |
| 2006.1.1-2006.12.31 | 2.49481% | 0.0027% | 1.8000% | 0.0003% | 0.69481% | 0.0024% |
| 2006.1.1-2006.12.31 | 1.9638% | 0.0019% | 1.8000% | 0.0005% | 0.1638% | 0.0014% |
| 2007.1.1-2007.12.31 | 3.2640% | 0.0046% | 2.7150% | 0.0018% | 0.5490% | 0.0028% |
| 2008.1.1-2008.12.31 | 3.9326% | 0.0148% | 3.1080% | 0.0032% | 0.8246% | 0.0116% |
| 2009.1.1-2009.12.31 | 1.7436% | 0.0069% | 1.2791% | 0.0001% | 0.3645% | 0.0068% |
| 2010.1.1-2010.12.31 | 2.1458% | 0.0039% | 1.2791% | 0.0000% | 0.7677% | 0.0039% |
| 2011.1.1-2011.12.31 | 4.0274% | 0.0030% | 1.4909% | 0.0001% | 2.5365% | 0.0029% |
| 2012.1.1-2012.12.31 | 4.3095% | 0.0032% | 1.4657% | 0.0002% | 2.8538% | 0.0030% |
| 2013.1.1-2013.12.31 | 4.3637% | 0.0029% | 1.2791% | 0.0000% | 2.9846% | 0.0029% |
| 2014.1.1-2014.12.31 | 4.9648% | 0.0021% | 1.2791% | 0.0000% | 3.5857% | 0.0021% |
| 2015.1.1-2015.12.31 | 3.7271% | 0.0030% | 1.2791% | 0.0000% | 2.3480% | 0.0030% |
| 2016.1.1-2016.12.31 | 2.8601% | 0.0069% | 1.3819% | 0.0000% | 1.4782% | 0.0069% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 3.6429% | 0.0014% | 1.2791% | 0.0000% | 2.2638% | 0.0014% |
| 2018.1.1-2018.6.30 | 2.0449% | 0.0006% | 0.6810% | 0.0000% | 1.3639% | 0.0006% |
| 自基金合同生效起至今 | 69.1758% | 0.0067% | 27.2813% | 0.0018% | 31.8945% | 0.0039% |

注:本基金收益分配为按月结转份额。

B级

| 阶段 | 份额净值收益率(1) | 份额净值收益率标准差(2) | 业绩比较基准收益率(3) | 业绩比较基准收益率标准差(4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2008.7.22-2009.12.31 | 1.0266% | 0.0096% | 0.6993% | 0.0000% | 0.4173% | 0.0096% |
| 2010.1.1-2010.12.31 | 2.3907% | 0.0039% | 1.3791% | 0.0000% | 1.0126% | 0.0039% |
| 2011.1.1-2011.12.31 | 4.2760% | 0.0030% | 1.4909% | 0.0001% | 2.7851% | 0.0029% |
| 2012.1.1-2012.12.31 | 4.5588% | 0.0032% | 1.4657% | 0.0002% | 3.1031% | 0.0030% |
| 2013.1.1-2013.12.31 | 4.6133% | 0.0029% | 1.2791% | 0.0000% | 3.2342% | 0.0029% |
| 2014.1.1-2014.12.31 | 5.2167% | 0.0021% | 1.2791% | 0.0000% | 3.9376% | 0.0021% |
| 2015.1.1-2015.12.31 | 3.9760% | 0.0030% | 1.2791% | 0.0000% | 2.6979% | 0.0030% |
| 2016.1.1-2016.12.31 | 2.9963% | 0.0069% | 1.3819% | 0.0000% | 1.4144% | 0.0069% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 3.8914% | 0.0014% | 1.2791% | 0.0000% | 2.5133% | 0.0014% |
| 2018.1.1-2018.6.30 | 2.1659% | 0.0006% | 0.6810% | 0.0000% | 1.4849% | 0.0006% |
| 自基金合同生效起至今 | 403.2291% | 0.0041% | 132.1296% | 0.0001% | 271.0095% | 0.0040% |

注:本基金收益分配为按月结转份额。

E级

| 阶段 | 份额净值收益率(1) | 份额净值收益率标准差(2) | 业绩比较基准收益率(3) | 业绩比较基准收益率标准差(4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2016.6.13-2016.12.31 | 1.4323% | 0.0010% | 0.7604% | 0.0000% | 0.6719% | 0.0010% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 3.6424% | 0.0014% | 1.2791% | 0.0000% | 2.3633% | 0.0014% |
| 2018.1.1-2018.6.30 | 2.0449% | 0.0006% | 0.6810% | 0.0000% | 1.3639% | 0.0006% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.2767% | 0.0019% | 2.8408% | 0.0000% | 4.4359% | 0.0019% |

注:本基金收益分配为按月结转份额。

F级

| 阶段 | 份额净值收益率(1) | 份额净值收益率标准差(2) | 业绩比较基准收益率(3) | 业绩比较基准收益率标准差(4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2016.9.26-2016.12.31 | 0.6829% | 0.0010% | 0.3644% | 0.0000% | 0.2885% | 0.0010% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 3.6416% | 0.0014% | 1.2791% | 0.0000% | 2.2625% | 0.0014% |
| 2018.1.1-2018.6.30 | 2.0447% | 0.0006% | 0.6810% | 0.0000% | 1.3637% | 0.0006% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.4808% | 0.0019% | 2.4367% | 0.0000% | 4.0141% | 0.0019% |

§13 基金的费用概览

(一)基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)持续销售费

(4)证券交易费用;

(5)基金信息披露费用;

(6)基金持有人大会费用;

(7)基金成立后与基金相关的会计师费和律师费;

(8)按照国家有关规定可以列入的其它费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下,本基金的管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下,本基金的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3.持续销售费

各级基金份额的持续销售费率均不超过0.25%年费率,各级基金份额计提的持续销售费率参见本基金的招募说明书。各级基金份额的持续销售费计算方法如下:

H=E×R÷当年天数

H为每日应计提的持续销售费

E为前一日该级基金资产净值

R为该级基金份额的持续销售费率

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的持续销售费率,但各级持续销售费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

各级基金份额的基金持续销售费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送持续销售费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出,经登记结算机构代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述(一)中(3)到(8)项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金成立前的信息披露费用是否列入基金费用依照中国证监会有关规定执行。

(四)基金管理人和基金托管人可破商的情降低基金管理费、基金托管费和基金持续销售费,下调前述费率无须召开基金持有人大会。基金管理人必须提议于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(五)基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下,对基金销售费用实行一定的优惠,费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

§14 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在"重要提示"部分,对"重要提示"进行了更新。

2.在"释义"部分,对"释义"进行了更新。

3.在"基金管理人"部分,对"主要人员情况"进行了更新。

4.在"基金托管人"部分,对"基金托管人"进行了更新。

5.在"相关服务机构"