

(上接B24版)

执行情况,评估风险管控报告,并进行投资管理。3. 投资管理方法(1)短期利率水平预期策略... (2)收益曲线分析策略... (3)组合剩余期限策略,期限配置策略... (4)类别品种配置策略... (5)流动性管理策略...

图1:嘉实货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图(2005年3月18日至2018年6月30日)

图2:嘉实货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图(2012年12月17日至2018年6月30日)

图3:嘉实货币E基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图(2016年4月20日至2018年6月30日)

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3个月内为建仓期,建仓期间本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十五节(二)投资范围和(三)投资限制的规定...

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。(2)报告期内未投资过品种分类的债券投资组合

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本内在应收利息。

注:报告期内本基金持仓资产公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。

注:本基金估值采用摊余成本法,估值对象以买入成本列示,按照票面利率计提应收利息或扣除摊销,每日计提损益或损失。