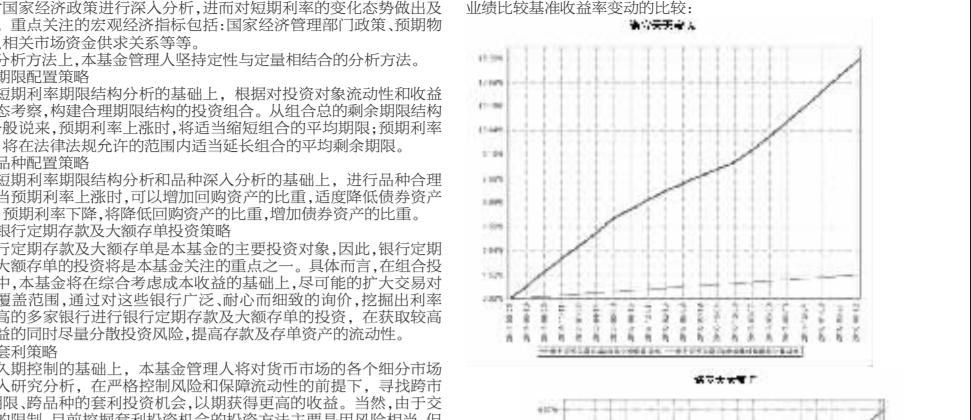


(上接B063版)
有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路687弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号
楼9层
法定代表人:马刚
联系人:庄洁茹
联系电话:021-60812006
客户服务电话:95156-5
网址:www.tonghuafund.com
(98) 上海通基基金管理有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展
展区)
办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002室
法定代表人:王伟
联系人:蓝杰
联系电话:021-65370077-220
客户服务电话:400-820-5369
网址:www.jiuyufund.com
(99) 天安万财财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦
公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辞
联系人:钟斐斐
联系电话:010-65370077-220
客户服务电话:400-820-5369
网址:www.jiuyufund.com
(100) 北京景华基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO T3 A座19层
法定代表人:戎兵
电话:18511290872
客户服务电话:010-59103825
网址:www.wanjianfund.com
(101) 大河财富基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路110-134号富中国际广场1栋
20层12号
法定代表人:王英
联系人:方凯鑫
电话:0955-4005606
客户服务电话:0955-88225678
网址:www.richfundapp.com
(102) 上海攀赢金融信息服务有限公司
注册地址:上海市闸北区中广西路1207号306室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路488号太平金融大厦603室
法定代表人:田为奇
客户服务电话:021-6889082
网址:www.pytz.cn
(103) 上海挖金金融信息服务有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01,02,03
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01,02,03
法定代表人:胡燕
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wzxin.com
(104) 济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
客户服务电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
(105) 北京君信基金销售有限公司
注册地址:北京市昌平区兴盛路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区兴盛路10号
法定代表人:于龙
客户服务电话:400-800-92123
网址:www.wzxin-inv.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
代理销售基金,并及时公告。
(1) 乙类份额的发售机构
1. 基金管理人网上直销系统
网址:www.ljfund.com.cn
客户服务电话:400-888-8908
2. 代销机构(排名不分先后)
(1) 桂林银行股份有限公司
注册地址:广西壮族自治区桂林市中山南路76号
办公地址:广西壮族自治区桂林市中山南路76号
法定代表人:王能
客户服务电话:400-869-6299(全国)或96299(广西专线)
网址:www.gulinbank.com.cn
(2) 江苏紫金农村商业银行股份有限公司
注册地址:南京市建邺区梦都大街136号
办公地址:南京市建邺区梦都大街136号
法定代表人:张小军
客户服务电话:96008
网址:www.jrcbank.com
(3) 中原银行股份有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大
楼
办公地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座大
楼
法定代表人:柴荣兴
客户服务电话:95186
网址:www.zybank.com
(4) 广发银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人:谢水林
电话:0755-82098888
传真:0755-82080714
联系人:周勤
客户服务热线:95511-3
网址:<http://bank.pingan.com>
(5) 首创证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
办公地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
法定代表人:陈灿辉
客户服务电话:400-188-8508
网址:www.shszq.com
(6) 联储证券有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心
大厦9层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路333号金砖大厦3层;
深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9层;
北京市朝阳区安定路6号3号中建财富国际中心27层
法定代表人:齐晋春
客户服务电话:400-773-7722
网址:www.bifund.com
(7) 上海华信证券投资有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:陈灿辉
联系人:李颖
联系电话:021-38784818-8508
客户服务电话:400-820-6999
网址:www.shhzxq.com
(8) 联讯证券有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心
大厦9层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路333号金砖大厦3层;
深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9层;
北京市朝阳区安定路6号3号中建财富国际中心27层
法定代表人:齐晋春
客户服务电话:400-188-8508
网址:www.bifund.com
(9) 第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
客户服务电话:95358
网址:www.yicbc.com
(10) 东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路128号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
联系人:王一平
电话:021-20333333
传真:021-50498825
客户服务电话:95531 或 400-8888-588
网址:www.longone.com
(11) 上海天基基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙茗路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙茗路88号东方财富大厦
法定代表人:其实
客户服务电话:400-1818-1885
网址:www.1234567.com
(12) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:陈培青
客户服务电话:400-773-7722
网址:www.bifund.com
(13) 上海倚锋基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧洲路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区高科西路1188号多斯大厦903-906室
法定代表人:黄文强
客户服务电话:400-700-9965
网址:www.shyf.com
(14) 北京景华基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
客户服务电话:400-001-9811
网址:www.jmwm.com
(15) 深圳众禄基金销售股份有限公司(原深圳众禄金融控股股份
有限公司)
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资投资置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资投资置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
客户服务电话:400-788-8887
网址:www.czcmw.com
(16) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈培青
客户服务电话:400-766-123
网址:www.fund123.com
(17) 深圳腾元基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区华富街道深南中路4026号田面城市大厦18层
办公地址:深圳市福田区深南中路4026号田面城市大厦18楼ABC
法定代表人:曾智
客户服务电话:4009-908-600
网址:www.tenrichfund.com
(18) 上海海量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高科路 526 号 2 楼 220 室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号 莫尼国际 B 座 16 层
法定代表人:张伟洪
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

D



指标,对国家经济政策进行深入分析,进而对短期利率的变化态势做出及
时反应。重点关注的宏观经济指标包括:国家经济管理部政策、预期物
价指数、相关市场价格关系等。

在分析方法上,基金管理人坚持定性与定量相结合的分析方法。

2.期限利率期限结构分析
在短期利率期限结构分析的基础上,根据对投资对象流动性和收益
性的动态考察,构建合理期限结构。从组合总的剩余期限结构来看,
一般说来,预期利率上涨时,将适当缩短组合的平均期限;预期利率
下降时,将在短期利率允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

3.品种配置策略
在短期利率期限结构分析和品种深入分析的基础上,进行品种合理
配置。当预期利率上涨时,可以增加回购资产的比重,适度降低债券资产
的比重;预期利率下跌时,将降低回购资产的比重,增加债券资产的比重。

4.定期存款定期存款及大额存单是本基金的主要投资对象,因此,银行定期
存款及大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。具体而言,在组合投
资过程中,本基金将在综合考虑成本收益的基础上,尽可能的通过交易对
手方的撮合成交,通过对这些银行定期存款、回购而细致的询价,挖掘出利率
报价较低且流动性较好的品种,同时进行银行定期存款和大额存单的投资,在获取较高
收益的同时尽量分散投资风险,提高资金及存单资产的流动性。

5.套利策略
在久期限制的基础上,本基金管理人将对货币市场的各个细分市场
进行深入研究分析,在严格控制风险和确保流动性的前提下,寻找跨市
场,跨期限,跨品种的套利投资机会,以期获得更高的收益。当然,由于交
易机制的限制,目前挖掘套利投资机会的投资方式主要是风险相当,但
收益更高的品种,如收益率相对较低的品种,或者用收益相当,风险较低的品种
替代风险较高的品种。

6.流动性管理策略
流动性好是市场基金的重要特征之一。在日常的投资管理过程中,
中,本基金将紧密关注申购/赎回/现金流变化情况,季节性资金流动等影
响货币市场基金流动性管理的因素,建立动态流动性监控管理指标,实现
对基金资产流动性的实时管理。

7.具体而言,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产
之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款和大额存单的投资,在获取较高
收益的同时,向回购、降级组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可
采用持续滚动投资方法,将回购或购入的到期日进行均衡等量配置,以满
足日常的基金资产变现需求。

8.基金的业绩比较基准
活期存款利率(税后)。

9.基金的风险收益特征
本基金属于货币基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合
型基金和债券型基金。

10.基金的投诉报告
本投诉组报告所载数据截止日为2018年6月30日,本报告中所列财
务数据未经审计。



注:本报告期内基金回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期
内每个交易日日常资金占资产净值的比例的简单平均值。
债券正回购的金额占基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本基金现金投资正回购的融资余额未超过资产净值的20%。

3.报告期基金投资组合平均剩余期限
(1) 投资组合平均剩余期限

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,217,136,693.2	27.05
2	其中:债券	1,217,136,693.2	27.05
3	货币市场基金	-	-
4	买入返售金融资产	235,461,026.0	5.27
5	其中:到期回购的买入 返售金融资产	-	-
6	卖出回购金融资产 准备金	-	-
7	其中:待摊费用和应付 备付金	2,072,893,044.65	46.13
8	其他资产	89,323,776.05	2.02
9	合计	4,412,894,593.40	100.00

2.报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期回购净额占基金资产净值的比 例(%)	-	3.46
2	其中:正回购的金额 占基金资产净值的比例(%)	-	-
3	报告期正回购的金额 占基金资产净值的比例(%)	604,788,003.64	14.30
4	报告期正回购的金额 占基金资产净值的比例(%)	-	-

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

债券正回购的金额占基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本基金现金投资正回购的融资余额未超过资产净值的20%。

4.报告期基金投资组合平均剩余期限
(1) 投资组合平均剩余期限

序号	项目	天数
1	回购协议投资	67
2	其中:定期存款	67
3	买入返售金融资产	76
4	其中:定期存款和大额存 款	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

(2) 基金投资组合平均剩余期限分布

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	27.34	14.39
2	30天(含)-90天	0.00	-
3	90天(含)-180天	26.37	0.00
4	180天(含)-397天	0.00	-
5	397天以上	44.66	0.00
6	180天以内	0.02	0.00
7	180天(含)-397天(含)	13.26	0.00
8	397天以上	0.00	-
9	合计	123.14	14.39

4.报告期基金组合平均剩余期限超过240天情况说明
本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过240天。

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

债券品种	金额单位:人民币元	
国债	摊余成本(元)	
1	国债	20,010,027.40
2	企业债	-
3	金融债	-
4	企业短期融资券	-
5	中期票据	-
6	资产支持证券	-
7	信用债	-
8	可转换债券	-
9	其他	-
10	剩余期限小于397天的 回购逆回购	-
11	剩余期限在397天以上的 回购逆回购	-
12	买入返售金融资产	-
13	卖出回购金融资产	-
14	同业存放	-
15	拆借	-
16	质押贷款	-
17	其他	-
18	合计	1,217,136,693.20

6.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券
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	1702007	17国债07	1,000,000	189,099,068.00	4.00
2	1902001	18国债01	1,200,000	120,269,477.19	3.12
3	1118140097	18沪苏行CD0097	1,000,000	98,006,000.00	2.54
4	111810240	18兴业银行CD0249	800,000	79,443,172.48	2.00
5	111810263	18兴业银行CD0263	800,000	79,356,028.00	2.00
6	150418	15农发行10	700,000	70,360,269.00	1.82
7	170410	17农发行10	600,000	59,360,030.47	1.56
8	011760806	17国开行15	500,000	50,266,177.00	1.30
9	011761083	17国开行15	500,000		