

广发天天红发起式货币市场基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：广发银行股份有限公司
时间：二〇一八年十二月

【重要提示】

本基金于2013年10月10日经中国证监会证监许可〔2013〕1287号文核准。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理人实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

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。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年10月22日，有关财务数据截止日为2018年9月30日，净值表现截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、概况

- 1.名称：广发基金管理有限公司
- 2.住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）
- 3.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31-33楼
- 4.法定代表人：孙树明
- 5.设立时间：2003年8月5日
- 6.电话：020-83936666
- 全国统一客服热线：96105828
- 7.联系人：邱春杨
- 8.注册资本：1.2888亿元人民币
- 9.股权结构：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股控股有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

孙树明先生：董事长，博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长，中国证券业协会第六届理事会兼职副会长，上海证券交易所第四届理事会理事，深圳证券交易所第二届监事会监事，中国上市公司协会第二届理事会兼职副会长，亚洲金融合作协会理事，中国注册会计师协会道德准则委员会委员，广东金融学会副会长，广东省预防腐败专家咨询委员会财政金融运行规范组成员，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。曾任财政部条法司副副处长、处长，中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，中共中央金融工委办公室监事会工作部副部长，中国银河证券股份有限公司监事会监事，中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传辉先生：副董事长，学士，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员、资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第四届上市委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

孙晓燕女士：董事，硕士，现任广发证券执行董事、副总经理、财务总监，兼任广发控股（香港）有限公司董事，证融股份有限公司监事长。曾任广东广发证券分公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部的副总经理，广发证券股份有限公司投资自营部副总经理，广发基金管理有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司财务部总经理。

戈俊先生：董事，硕士，高级会计师，现任烽火通信科技股份有限公司总裁，兼任南京烽火星空通信发展有限公司董事。曾任烽火通信科技股份有限公司财务部总经理助理、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

翟美卿女士：董事，硕士，现任深圳香江控股股份有限公司董事长、南方香港集团董事长、总经理，香江集团有限公司总裁、深圳市金海马实业股份有限公司董事长。兼任全国政协委员、全国妇联常委、中国女企业家协会副会长、广东省妇联副主席，广东省工商联副主席，广东省女企业家协会会长，广东社会救助基金会主席，深圳市深商控股集团股份有限公司董事长，广东南粤银行董事，深圳龙岗国家农镇银行董事。曾任深圳市前海香江金融控股股份有限公司法定代表人、董事长。

许冬雄女士：董事，硕士，副主任药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、常务副总经理，兼任世界中联中药饮片质量专业委员会副会长、中国中医药管理局对外交流合作专家咨询委员会委员、全国中药药妆化妆品专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会副主任委员、国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药制剂与配置工程专业专家委员会主任委员，广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。

罗海平先生：独立董事，博士，现任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理、集团风控党委书记，兼任银保监会行业风险评估专家。曾任中国人民保险集团公司副经理，湖北省分公司国际保险部党组书记、总经理、汉口分公司党委书记、总经理，太平保险有限公司市场部总经理、湖北分公司党委书记、总经理，助理总经理，副总经理兼董事会秘书，阳光财产保险股份有限公司总经理，阳光保险集团执行委员会委员，中华联合财产保险股份有限公司总经理、董事长、党委书记。

董茂云先生：独立董事，博士，现任宁波大学法学院教授、学术委员会主任，复旦大学兼职教授，浙江合创律师事务所兼职律师。曾任复旦大学教授、法律系副主任、法学院副院长，海尔施生物医药股份有限公司独立董事。

姚海鑫先生：独立董事，博士、教授、博士生导师，现任辽宁大学新华国际商学院教授、辽宁大学商学院博士生导师，兼任中国会计教授会理事、东北地区高校财务与会计教师联合会常务理事、辽宁省生产力学会副理事长、东北制药（集团）股份有限公司独立董事、沈阳化工股份有限公司独立董事和中兴-沈阳商业大厦（集团）股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记、新华国际商学院副院长。

12.监事会成员

符兵先生：监事会主席，硕士，经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长，广东发展银行广州分行世贸支行行长、总行资金部处长，广发基金管理有限公司广州分公司总经理、市场拓展部副总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡亚娟女士：股东监事，硕士，高级涉外秘书，现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任，广州屈臣氏公司行政主管，广州市科达实业发展有限公司办公室主任、总经理，广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉先生：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理，兼任广发基金分工主任。曾任广发证券电脑中心经理、经理。

张成柱先生：职工监事，学士，现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师，广发证券股份有限公司广州、广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘敏女士：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理，营销服务部总经理助理，产品营销管理部总经理助理。

3.总经理及其他高级管理人员

林传辉先生：总经理，学士，兼任广发国际资产管理有限公司董事长，瑞元资本管理有限公司董事，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

朱平先生：副总经理，硕士，经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理，易方达基金管理有限公司投资部研究负责人，广发基金管理有限公司总经理助理，中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。

易阳方先生：副总经理，硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监，广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理，中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员，广发基金管理有限公司投资管理部总经理、公司副总经理、广发聚富开放式证券投资基金基金经理、广发制造业精选混合型证券投资基金基金经理、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理、广发聚丰混合型证券投资基金基金经理、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，瑞元资本管理有限公司董事。

邱春杨先生：督察长，博士。曾任广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、产品总监、副总经理，广发沪深300指数证券投资基金基金经理、广发中证500指数证券投资基金基金经理，瑞元资本管理有限公司董事。

魏恒江先生：副总经理，硕士，高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士：副总经理，硕士，兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国银行业科学院助理研究员，中国证监会培训中心、监察局科员，基金监管部副处长及处长，私募基金监管部处长。

张芊女士：副总经理，硕士。兼任广发基金管理有限公司固定收益投资总监、广发纯债债券型证券投资基金基金经理，广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理、广发鑫鑫债券型证券投资基金基金经理、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发集创债券型证券投资基金基金经理、广发集丰债券型证券投资基金基金经理、广发集源债券型证券投资基金基金经理。曾在施耐德电气公司、中国银河证券、中国广核资产管理公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司固定收益部总经理，广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发集安债券型证券投资基金基金经理。

王凡先生：副总经理，博士。曾在财政部、全国社保基金理事会、易方达基金管理有限公司工作。

4.基金经理

任爽女士：经济学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼任研究员，广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年11月16日至2018年3月20日），广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年12月2日至2018年11月9日）。现任广发纯债债券型证券投资基金基金经理（自2012年12月12日起任职）、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理（自2013年6月20日起任职）、广发天天红发起式货币市场基金基金经理（自2013年10月22日起任职）、广发天天红货币市场基金基金经理（自2014年1月27日起任职）、广发钱袋子货币市场基金基金经理（自2014年5月30日起任职）、广发活期宝货币市场基金基金经理（自2014年8月28日起任职）、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理（自2015年6月8日起任职）、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理（自2016年3月21日起任职）、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年1月116日起任职）、广发鑫盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月9日起任职）、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自2018年3月21日起任职）。

温秀娟女士：经济学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理。现任广发基金管理有限公司现金投资部总经理、广发货币市场基金基金经理（自2010年4月29日起任职）、广发理财30天债券型证券投资基金基金经理（自2013年1月14日起任职）、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理（自2013年6月20日起任职）、广发发现宝现金实时申赎货币市场基金基金经理（自2013年12月2日起任职）、广发活期宝货币市场基金基金经理（自2014年8月28日起任职）、广发添利交易型货币市场基金基金经理（自2016年11月22日起任职）、广发天天红发起式货币市场基金基金经理（自2017年10月31日起任职）。

历任基金经理：周昌杰，任职时间为2013年10月22日至2017年10月31日。

5.基金投资采取集体决策制度。基金管理人固定收益委员会由副总经理张芊女士、债券投资部总经理谢国军先生、现金投资部总经理温秀娟女士、债券投资部固定收益部交易员和固定收益研究部副总经理韩晟先生等组成成员，张芊女士担任投委会主席。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基本情况

名称：广发银行股份有限公司
住所：广州市越秀区东风东路713号
办公地址：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：杨明生
成立时间：1988年7月8日
组织形式：股份有限公司
注册资本：154亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363号
联系人：周小磊
联系电话：（010）65169562
广发银行股份有限公司成立于1983年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本154亿元。二十多年来，广发银行风雨同舟，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

截至2017年12月31日，广发银行总资产20729.15亿元、总负债19590.69亿元，实现营业收入506.31亿元、拨备前利润291.61亿元。据英国《银行家》杂志2017年全球银行排名，本行按一级资本列第93位。

二、主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设客户营销处、保险与期货业务处、增值与外包业务处、业务运行处、内控与综合管理处，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人蒋柯先生，经济学硕士，高级经济师，从事托管工作二十一年，托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副科长、全球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长（主持工作）等职务。曾被中国证监会批准为证券投资基金估值工作小组副组长。2015年1月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理。2018年7月任广发银行资产托管部总经理。

部门负责人梁冰女士，经济学博士，研究员，曾任中国人民银行研究局产业经济研究处副处长、金融法律研究处副处长、处长，广发银行总行金融机构部副总经理等职务，曾在遵义市人民政府挂职1年。2018年6月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理。

三、基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开展证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363号，截至2017年12月末，托管资产规模23,188.47亿元。建立了一支优秀、专业的托管业务团队，保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线，产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、ODII托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等，能为托管产品提供全面、专业的托管服务。

三、部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务：

（1）广州分公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔10楼
直销中心电话：020-89899073

传真：020-89899069 020-89899070

（2）北京分公司

地址：北京市西城区金融大街9号9楼11层1101单元

（电梯楼层12层1201单元）

电话：010-68083113

传真：010-68083078

（3）上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路166号905-10室

电话：021-68885310

传真：021-68885200

（4）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：www.gffunds.com.cn

本公司网址：www.gffunds.com.cn

客服电话：95105828（免长途费）或020-83936999

客服传真：020-34281105

二、注册登记人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）

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31-33楼

法定代表人：孙树明

电话：020-89899129

传真：020-89899175

联系人：李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：广东广信君达律师事务所

住所：广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州周大福金融中心29层、10层

负责人：王晓华

电话：020-37181333

传真：020-37181388

经办律师：王晓华

联系人：刘智、杨琳

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法人代表：毛鞍宁

电话：020-28812888

传真：020-28812618

经办注册会计师：赵娜、李明明

四、基金名称
天天红发起式货币市场基金

五、基金类型
货币市场基金

六、基金的投资目标
在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。

七、基金的投资方向
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下：

1、现金；
2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款（包括活期存款、定期存款、通知存款、大额存单等）、债券回购、中央银行票据、同业存单；
3、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（包括但不限于短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券；

4、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金融工具，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金投资策略
本基金将在深入研究国内外宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。

（一）利率预期策略
影响利率走势的因素很多，影响短期利率变动的因素更多，运行方式也更为复杂。基金管理人将重点考察以下两个因素：

1、中央银行、财政部等国家宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场运行的影响非常深远。国家宏观经济管理部门尤其是中央银行对经济运行形势的判断及采取的应对政策是影响市场利率走势的关键因素之一。
2、短期资金供求变化。短期资金市场参与者的头寸紧张程度是短期利率变动的重要主导力量。短期利率随短期资金供求变化呈一定的季节性波动特征。

具体而言，本基金管理人将持续跟踪反映国民经济变化的宏观经济指标，对国家政策进行深入分析，进而对短期利率的变化态势做出及时、重点关注的宏观经济指标包括：国家经济管理部门政策、预期物价指数、相关市场资金供求关系等等。

（二）期限预期策略
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，构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看，一般来说，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，将在法律法规允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

（三）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；预期利率下降，将降低回购资产的比重，增加债券资产的比重。

（四）银行定期存款及大额存单投资策略
银行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，尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围，通过对这些银行广泛、耐心而细致的询价，挖掘出利率对较高的多家银行间进行银行定期存款及大额存单的投资，在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险，提高存款及存单资产的流动性。

（五）套利策略
在久期控制的基础上，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，在严格控制风险和保障流动性的前提下，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法主要是用风险相当，但收益更高的品种替代收益较低的品种，或者用收益相当，风险较低的品种替代风险较高的品种。

（六）流动性管理策略
流动性好是货币市场基金的重要特征之一。在日常的投资管理过程中，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，建立组合流动性监控管理指标，实现对基金资产流动性的实时管理。

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、银行定期存款提前支取、持有高流动性资产、正向回购、降低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式，将回购或债券的到期日进行均衡等配置，以满足日常的基金资产变现需求。

九、基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：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，如果活期存款利率发生较大变化时，则新的业绩比较基准将按照调整当日起开始生效。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、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。

十、基金的风险收益特征

本基金属于货币市场基金，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。

十一、基金的投资组合报告

本基金管理人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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年11月27日复核了本报告中财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	23,069,724,849.34	67.77
	其中：债券	23,069,724,849.34	67.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	8,218,651,772.82	20.59
	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	8,562,440,530.40	21.42
4	其他资产	87,762,669.66	0.22
5	合计	39,918,579,822.27	100.00

2 报告期末债券回购融资情况

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	3.81	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,152,691,290.90	11.62
	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报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

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%。

3 基金投资组合平均剩余期限

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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

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	31.46	11.62
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天(含)-60天	4.33	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天(含)-90天	26.01	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天(含)-120天	0.92	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天(含)-397天(含)	48.76	-
	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	-	-
	合计	111.47	11.62

报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

2	央行票据		—
3	金融债券	430,728,657.06	1.21
	其中:政策性金融债	430,728,657.06	1.21
4	企业债券		—
5	企业短期融资券	640,123,690.29	1.79
6	中期票据		—
7	同业存单	20,465,283,878.48	57.28
8	其他		—
9	合计	23,069,724,849.34	64.54
10	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券		—