（上接B078版）

法定代表人:李刚
联系人:袁伟涛
电话:029-81887060
传真:029-81887060
客服电话:4008608866
公司网址:www.kysec.cn
82）北京恒宇天泽基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋883室内
办公地址:北京市东城区东滨河路乙1号航星园8号楼（东半楼）6层
法定代表人:郭军爱
联系人:魏燕军
电话:400-188-8848
传真:010-84259205
客服电话:400-188-8848
公司网址:www.1314fund.com
83）徽商银行股份有限公司
注册地址:安徽合肥安庆路79号天徽大厦A座
办公地址:安徽合肥安庆路79号天徽大厦A座
法定代表人:李宏鸣
联系人:叶卓伟
电话:0551-62667635
传真:0551-62667684
客服电话:96588
公司网址:www.hsbank.com.cn
84）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
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号北美广场A座1002室
法定代表人:王翔
联系人:俞申莉
电话:021-65370077
传真:021-55085991
客服电话:4008-205-369
公司网址:www.jiyufund.com.cn
85）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人:王兴吉
联系人:宋子琪
电话:18500501595
传真:010-82057741
客服电话:4000888080
公司网址:www.qiandaojr.com
86）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11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人:王伟刚
联系人:李瑞真
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:4006199059
公司网址:www.hcjijin.com
87）大连网金基金销售有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2层202室
办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2层202室
法定代表人:卜勇
联系人:贾伟刚
电话:0411-3902-7828
传真:（0411）3902 7888
客服电话:4000-899-100
公司网址:www.yibaijin.com
88）奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健，pss-team@ifastfinancial.com.cn
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn
89）北京懒猫金融信息服务有限公司
注册地址:北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址:北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号（国投尚科大厦5层）
法定代表人:许现良
联系人:李雪
电话:13426481033
传真:010-87723200
客服电话:4001-500-882
公司网址:www.lanmao.com
90）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5层518室
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5层518室
法定代表人:李昭琛
联系人:付文红
电话:010-60616511
传真:8610-62676582
客服电话:010-62675369
公司网址:www.xincai.com
91）尚智逢源（北京）基金销售有限公司
注册地址:北京市门头沟区石龙经济开发区永安路20号3号楼B1-6525室
办公地址:北京市门头沟区石龙经济开发区永安路20号3号楼B1-6525室
法定代表人:刘磊
联系人:刘蕾
电话:010-65602060 / 15618301166
传真:010-65602060
客服电话:400-920-6677
公司网址:http://www.szfyfund.com
92）北京微动利基金销售有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人:梁洪军
联系人:何鹏
电话:010-52609656
传真:010-51957430
客服电话:4001885687
公司网址:www.buyforyou.com.cn
93）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504
法定代表人:陈洪生
联系人:陈承智
电话:0592-3122673
传真:0592-3122701
客服电话:4009180808
公司网址:www.xds.com.cn
94）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21层
法定代表人:蒋煜
联系人:姜斌 徐长征 刘聪慧电话:010-58170708
传真:010-58170900
客服电话:400-818-8866
公司网址:http://www.shengshiview.com/
95）联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:广东省惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:徐刚
联系人:彭莲
电话:0752-2119700
传真:0752-2119660
客服电话:95564
公司网址:www.lxsec.com
96）江苏银行股份有限公司
注册地址:中国江苏省南京市中华路26号
办公地址:中国江苏省南京市中华路26号
法定代表人:夏平
联系人:张洪玮
电话:025-58587036
传真:025-58588720
客服电话:95319
公司网址:www.jsbchina.cn
97）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:李悦
联系人:张晔
电话:010-56642600
传真:010-56642623
客服电话:4007868868
公司网址:www.chtfund.com
98）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
联系人:李海燕
电话:010-65309516-814
传真:010-65330699
客服电话:400-673-7010
公司网址:www.jianfortune.com
99）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人:高锋
联系人:廖苑兰
电话:0755-83655588
传真:0755-83655518
客服电话:400-804-8688
公司网址:www.keynesasset.com
100）上海攀赢基金销售有限公司
注册地址:上海市闸北区广中西路1207号306室
办公地址:上海浦东新区银城中路488号太平金融大厦603单元
法定代表人:田为奇
联系人:吴卫东
电话:13918302493
传真:021-68889283
客服电话:021-68889082
公司网址:www.pytz.cn
101）徽商期货有限责任公司
注册地址:芜湖路258号
办公地址:芜湖路258号
法定代表人:吴国华
联系人:蔡芳
电话:0551-62862801
传真:0551-62862801
客服电话:400 887 8707
公司网址:www.hsqh.net
102）南京途牛基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人:宋时琳
联系人:王旋
电话:025-86853969
传真:025-86853960
客服电话:4007-999-999转3
公司网址:http://jr.tuniu.com
103）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号期货大厦14楼
办公地址:上海市黄浦区中山南路318号2号楼22楼
法定代表人:卢大印
联系人:龚栩生
电话:021-63325888-3916
传真:021-63326752
客服电话:95503
公司网址:www.dzqh.com.cn
104）华泰期货有限公司
注册地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层
办公地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层
法定代表人(代为履职):徐炜中
联系人:黄韵钰/刘昆/张帆
电话:0755-23887950/0755-23887975/0755-82776680
传真:0755-82777490
客服电话:400-628-0888
公司网址:www.htfc.com
105）民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座18层
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座18层
法定代表人:冯鹤年
联系人:李微
电话:010-85127570
传真:010-85127641
客服电话:4006198888
公司网址:www.mszq.com
106）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268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
联系人:仲秋玥
电话:010-88066632
传真:010-88066552
客服电话:400-817-5666
公司网址:www.amcfortune.com
107）金堆家保险代理有限公司
注册地址:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址:北京西城区阜成门外大街2号万通新世界A2106
法定代表人:夏子柱
联系人:胡明哲
电话:010-68091380
传真:010-68091380
客服电话:400-106-0101
公司网址:www.jhjfund.com
108）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
办公地址:湖北省武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
法定代表人:陶捷
联系人:沈怡
电话:027-83863742
传真:027-83862682
客服电话:400-027-9899
公司网址:www.buyfunds.cn
109）大有期货有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
法定代表人:沈众辉
联系人:马利
电话:0731-84409106
传真:0731-84409009
客服电话:4006 365 058
公司网址:www.dayouf.com
110）联储证券有限责任公司
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楼
办公地址:北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层联储证券
法定代表人:吕春卫
联系人:丁俏云
电话:010-86499427
传真:010-86499401
客服电话:400-620-6868
公司网址:www.lczq.com
111）上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
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室
法定代表人:冷飞
联系人:李娟
电话:021-50810687
传真:021-58300279
客服电话:021-50810673
公司网址:www.wacaijijin.com
112）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
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:汪静波
联系人:朱了了
电话:021-80358749
公司网址: www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399
146）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09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:程晨
公司网址:www.lufunds.com
客服电话:4008219031
147）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1603
办公地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
法定代表人: 胡伟
联系人:陈铭洲
公司网址:www.pintec.com
客服电话:400-068-1176
148）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海横琴新区宝华路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楼1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
公司网址:www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066
149）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359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:江苏省南京市秦淮区中山南路1号南京中心66楼
法定代表人:袁顾明
联系人:孟召社
联系电话:021-20324176
公司网址:www.dtfunds.com
客服电话:400-928-2266
150）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
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
公司网址:www.66zichan.com
客服电话:4000-466-788
151）和耕传承基金销售有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区心仪路西广场路南升龙广场2号楼701
办公地址:河南省郑州市郑东新区心仪路西广场路南升龙广场2号楼701
法定代表人:李淑慧
联系人:郭兆英
联系电话:0371-5521 3196
公司网址:www.hgccph.com
客服电话:4000555671
152）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:张林
联系电话:010-65983311
公司网址:www.igesafe.com
客服电话:010-82350618
153）深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
办公地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人:刘鹏宇
联系人:刘勇
联系电话:0755-83999907-8814
公司网址:www.jinqianwo.cn
客服电话:0755-83999907
154）海银基金销售有限公司
注册地址: 上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址: 上海市浦东新区东方路1217号6楼
法定代表人: 刘惠
联系人:毛林
联系电话:021-80133597
公司网址:www.fundhaiyin.com
客服电话:400-808-1016
155）北京电盈基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
联系电话:010-56176104
公司网址:www.dianyingfund.com
客服电话:400-100-3391
156）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
注册地址:上海市黄浦区延安东路凯石大厦4F
法定代表人:陈继武
联系人:黄祎
公司网址: www.vstonewealth.com
客服电话:4000-178-000
157）北京广源达信投资管理有限公司
注册地址: 北京是西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
联系人:王永霞
联系电话: 010-82055860
公司网址:www.niuniufund.com
客服电话:400-623-6060
158）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苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
公司网址:www.jfzinv.com
客服电话:4009500888
159）上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
客服电话:021-51327185
160）北京蛋卷基金销售有限公司
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
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO 塔3 19层
法定代表人:钟斐斐
联系人:秦艳琴
公司网址:https://danjuanapp.com/
客服电话:4000618518
161）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
办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人: 黄欣
联系人:戴琛微
联系电话:021-33768132-801
公司网址:www.zzwealth.cn
客服电话:400-6767-5263
162）西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦
法定代表人:陈宏
联系人: 杨雷
客服电话:95357
公司网址:http://www.18.cn
163）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2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
联系人:孟汉霄
联系电话:010-59336498
公司网址: www.jnlc.com
客服电话:4008-909-998
164）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
法定代表人: 陈超
联系人: 韩锦星
公司网址: http://fund.jd.com
客服电话:95518
165）上海云湾投资管理有限公司
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
办公地址:上海市锦康路308号7楼
法定代表人:戴新装
联系人: 范泽杰
联系电话:021-20530186
公司网址: www.zhengtongfunds.com
客服电话:400-820-1515
166）天津国美基金销售有限公司
注册地址:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室
办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人:丁东华
联系人: 许艳
公司网址:www.gomefund.com
客服电话:400-111-0889
167）上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人: 郭林
联系人: 李颖
联系电话: 021-38784818-8508
公司网址:www.shhxzq.com
客服电话:400-820-5999
168）上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址:浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址:上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法定代表人:廖冰
联系人: 裘爱萍
联系电话: 021-80234888-6693
公司网址:www.998fund.com
客服电话:400-998-7172
169）新纪元期货股份有限公司
注册地址:江苏省徐州市淮海东路153号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦8楼
法定代表人:刘莎
联系人: 王诗航
公司网址:www.neweraqh.com.cn
客服电话:0516-83831115
170）上海有鱼基金销售有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址:上海徐汇区桂平路391号B座19层
法定代表人:林琼
联系人: 黄志鹏
客服电话:021-60907978
公司网址: www.youyufund.com
171）上海通华财富资产管理有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667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楼
法定代表人:兰奇
联系人: 庄浩茹
客服电话:95156转5
公司网址:www.tonghuafund.com
172）深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
办公地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
法定代表人:苗宏升
联系人: 胡碧宣
客服电话:4007-903-688
公司网址:http://www.fundying.com
173）中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄 证大五道口广场1号楼27层
法定代表人:弭洪军
联系人: 黄鹏
客服电话:400-876-5716
公司网址:https://www.cmiwm.com/
3、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）注册登记机构
名称:华泰柏瑞基金管理有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人:贾波
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
电话:（021）38601777
传真:（021）50103016
联系人:赵景云
（三）律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
负责人:王玲
联系电话:021-24126000
传真:021-24126150
经办律师:靳庆军、黄晓黎
联系人:黄晓黎
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
经办注册会计师:单峰、曹阳
电话:021-23238888
传真:021-23238800
四、基金的名称
华泰柏瑞货币市场证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式、货币市场基金
六、基金的投资目标
在有效保持基金资产安全和高流动性的前提下，追求超过业绩基准的稳健投资收益。
七、基金的投资范围
本基金投资于以下金融工具:
1、现金;
2、期限在1 年以内（含1 年）的银行存款、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、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。
对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
八、基金的投资策略
本基金将采用主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资，在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，获得稳健的投资收益。
1、利率预期策略:本基金将首先采用利率预期策略（Interest-Rate Expectation Strategy），通过利率分析系统、综合研究国内外宏观经济趋势、财政及货币政策导向、短期资金的供求状况等因素从而对货币市场利率走势进行预测。根据对未来利率走势的科学预测最终形成投资组合的平均剩余期限，若预测未来利率将上升，则降低投资组合的平均剩余期限，反之，则增加投资组合的平均剩余期限。本基金的平均剩余期限将控制在120天之内。
2、估值中枢策略:运用不同品种的收益率曲线预测模型，对货币市场工具进行合理估值，确定价格中枢的变动趋势。综合考虑基金资产组合的流动性、收益率、风险等因素以及债券的估值原则，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化作相应调整。
3、类属配置策略:在保持组合资产相对稳定的条件下，本基金在实际操作中将主要依据各类短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境，决定不同类属的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别品种的具体资产配置比例。
4、流动性管理策略:本基金将在动态测算基金投资者净赎回资金需求、季节性资金流动等因素的前提下，对基金资产进行合理配置，通过实时追踪基金资产的现金库存、资产变现能力等因素，合理配置和动态调整组合现金流，在保持基金财产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益，结合持续性投资的方法，将各类属资产的到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。
九、业绩比较基准
当期银行活期存款税后收益率。
基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下，可根据投资目标、投资方向和投资策略，确定变更业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人应在调整前在至少一种指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。
十、风险收益特征
本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
十一、基金投资组合报告
投资组合报告截止日为2018年9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	3,834,723,647.42	34.87
	其中:债券	3,810,672,159.85	34.65
	资产支持证券	24,051,487.57	0.22
2	买入返售金融资产	2,698,105,454.05	24.54
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	97,646,188.36	0.89
3	银行存款和结算备付金合计	4,419,320,052.98	40.19
4	其他资产	44,299,957.89	0.40
5	合计	10,996,449,112.34	100.00

2、报告期债券回购融资情况

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	3.07
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,321,043,978.43	13.72
	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
注:在本报告期内本基金债券正回购的基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
报告期末投资组合平均剩余期限	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
注:在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120天。
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	63.04	13.72
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)-60天	19.77	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)-90天	5.93	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)-120天	10.53	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)-397天（含）	14.46	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	113.73	13.72

报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
注:在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。
4、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）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	49,913,616.30	0.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	891,792,606.72	9.26
	其中:政策性金融债	891,792,606.72	9.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	350,010,884.60	3.63
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,518,955,052.23	26.16
8	其他	-	-
9	合计	3,810,672,159.85	39.57
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5、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	180201	18国开01	3,800,000	381,156,101.37	3.96
2	011801347	18陕延油SCP007	2,000,000	200,008,241.17	2.08
3	111890076	18重庆农村商行CD007	2,000,000	199,868,997.06	2.08
4	111896467	18厦门国际银行CD074	2,000,000	199,766,599.32	2.07
5	111811268	18平安银行CD268	2,000,000	199,748,959.49	2.07
6	111820169	18广发银行CD169	2,000,000	199,036,020.93	2.07
7	111820089	18广发银行CD089	2,000,000	197,437,890.07	2.05
8	180301	18进出01	1,900,000	190,011,530.81	1.97
9	160202	16国开02	1,700,000	169,810,818.40	1.76
10	111881703	18成都农商银行CD011	1,500,000	149,620,650.80	1.55

6、"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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1444%
报告期内偏离度的最低值	0.0562%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0870%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
注:无。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
注:无。
7、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投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889112	18上和1A1	1,000,000.00	24,051,487.57	0.25

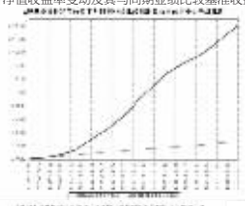
8、投资组合报告附注
1）本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。
本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币1.00 元。
2）本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
3）其他资产构成

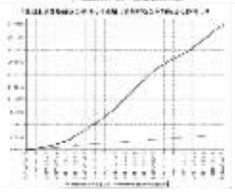
序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	44,299,957.89
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	44,299,957.89

十二、基金的业绩
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。
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2018年9月30日。
1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

	阶段	净值收益率①	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
A类	基金合同生效日至2009年年底	0.2630%	0.0006%	0.2400%	-	0.0230%	0.0006%
	2010年	0.9293%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.5643%	0.0011%
	2011年	2.3200%	0.0025%	0.4762%	0.0001%	1.8438%	0.0024%
	2012年	3.1068%	0.0029%	0.4260%	0.0002%	2.6808%	0.0027%
	2013年	4.1323%	0.0032%	0.3549%	0.0000%	3.7774%	0.0032%
	2014年	4.5776%	0.0041%	0.3549%	0.0000%	4.2227%	0.0041%
	2015年	3.7038%	0.0066%	0.3549%	0.0000%	3.3489%	0.0066%
	2016年	2.4159%	0.0012%	0.3558%	0.0000%	2.0601%	0.0012%
	2017年	3.4911%	0.0013%	0.3549%	0.0000%	3.1362%	0.0013%
	2018年上半年	1.9076%	0.0050%	0.1760%	0.0000%	1.7316%	0.0050%
	过去三个月	0.6564%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.5670%	0.0011%
B类	基金合同生效日至2009年年底	0.4225%	0.0006%	0.2400%	-	0.1825%	0.0005%
	2010年	1.1701%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.8051%	0.0011%
	2011年	2.5603%	0.0025%	0.4762%	0.0001%	2.0841%	0.0024%
	2012年	3.3471%	0.0029%	0.4260%	0.0002%	2.9211%	0.0027%
	2013年	4.3717%	0.0032%	0.3549%	0.0000%	4.0168%	0.0032%
	2014年	4.8177%	0.0042%	0.3549%	0.0000%	4.4628%	0.0042%
	2015年	3.9443%	0.0066%	0.3549%	0.0000%	3.5894%	0.0066%
	2016年	2.6559%	0.0012%	0.3558%	0.0000%	2.3001%	0.0012%
	2017年	3.7334%	0.0013%	0.3549%	0.0000%	3.3785%	0.0013%
	2018年上半年	2.0266%	0.0050%	0.1760%	0.0000%	1.8506%	0.0050%
	过去三个月	0.7170%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.6276%	0.0011%

注:本基金的收益分配是按月结转份额。
2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





十三、基金的费用与税收
（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、销售服务费;
4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等）;
5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费;
8、基金的资金汇划费用;
9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
（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
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。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为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
在首期支付基金管理费前，基金管理人应向基金托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。此账户原则上一旦指定不可变更。如确有需要变更，基金管理人应提前10个工作日向基金托管人出具书面的收款账户变更通知。
2、基金托管人的托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。
在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。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为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
3、基金销售服务费
基金销售服务费用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等活动。本基金各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，但各类基金份额的销售服务费年费率均不超过0.25%。
各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:
H = E × 年销售服务费率 ÷ 当年天数
H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日该类基金份额的基金资产净值
各类基金份额计提的销售服务费率参见本基金的招募说明书或更新后的招募说明书。基金管理人可以调整对各类基金份额计提的销售服务费率，但销售服务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的3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒介上刊登公告并报中国证监会备案。
基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人相应支付给基金销售机构。
在首期支付销售服务费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定销售服务费的收款账户。此账户原则上一旦指定不可变更。如确有需要变更，基金管理人应提前10个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。
上述"（一）基金费用的种类"中第4－9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（三）不列入基金