

(上接B018版)

网址:www.myfund.com
 (55)名称:蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
 住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座17楼
 法定代表人:陈柏青
 联系人:韩爱彬
 客服电话:4000-766-123
 网址:www.fund123.com
 (56)名称:深圳众禄基金销售股份有限公司
 住所:广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
 办公地址:广东省深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
 法定代表人:薛峰
 电话:0755-33227950
 联系人:童彩平
 客服电话:4006-788-887
 网址:www.zlfund.cn
 (57)名称:和讯信息科技有限公司
 住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 法定代表人:王松
 电话:010-88696028
 联系人:刘洋
 客服电话:400-920-0022
 网址:licaikaihexun.com
 (58)名称:众升财富(北京)基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
 办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
 法定代表人:李招弟
 (10)名称:北京微动利基金销售有限公司
 住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商务楼341室
 办公地址:北京市石景山区古城西路113号3层341-342室
 法定代表人:梁洪军
 电话:010-52609666
 联系人:李长军
 客服电话:400-188-5687
 网址:www.huoyiforyou.com.cn
 (79)名称:北京亿金鑫基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号36层3603室
 办公地址:北京市东城区朝门内大街8号富华大厦B座12层B室
 法定代表人:程刚
 电话:010-56176118
 联系人:张旭
 客服电话:400-100-3391
 网址:www.dlianyingfund.com
 (80)名称:北京汇成基金销售有限公司
 住所:北京市海淀区中关村大街11号1111108室
 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号111108室
 法定代表人:王俐刚
 电话:010-62680527
 联系人:丁向冲
 客服电话:400-619-9069
 网址:www.hcjin.com
 (81)名称:北京展 vista 下投资管理有限公司
 住所:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村736号03室
 办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21&28层
 法定代表人:李浩
 客服电话:400-001-8811
 网址:http://www.zvcv.com.cn
 (61)名称:上海利得基金销售有限公司
 住所:上海市宝山区蕰川路6475号1033室
 办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼14楼
 法定代表人:李兴春
 电话:021-50683533
 联系人:郭彤彤
 客服电话:400-921-7765
 网址:www.leadfund.com.cn
 (62)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
 住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室
 办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大厦
 法定代表人:凌顺平
 电话:0571-88911818
 联系人:吴强
 客服电话:4008-773-772
 网址:www.5ifund.com
 (63)名称:北京钱景基金销售有限公司
 住所:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
 办公地址:北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO1006-1008
 法定代表人:赵斌春
 电话:010-57418813
 联系人:李皓
 客服电话:400-893-6895
 网址:www.qianjing.com
 (64)名称:浙江金观诚基金销售有限公司
 住所:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
 办公地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
 法定代表人:蒋雪梅
 电话:0571-88337177
 联系人:孙成岩
 客服电话:400-068-0068
 网址:www.jincheng-fund.com
 (65)名称:海银基金销售有限公司
 住所:上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场6楼B单元
 办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
 法定代表人:刘鑫
 电话:021-80133828
 联系人:徐琳琳
 客服电话:400-808-1016
 网址:www.fundhaiyin.com
 (66)名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
 住所:深圳市福田区福田街道田田路178号华融大厦27层2704
 办公地址:北京市西城区宣武门大街28号富都大厦16层
 法定代表人:马勇
 电话:010-83363101
 联系人:文雯
 客服电话:400-166-1188
 网址:http://8.rjzq.com.cn
 (67)名称:上海鼎信基金销售有限公司
 住所: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15楼
 法定代表人:王之光
 电话:021-20666562
 联系人:宁博宇
 客服电话:400-821-9031
 网址:www.funddixun.com
 (58)名称:北京虹点基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元
 办公地址:北京市朝阳区工体北路甲2号盈科中心东二门二层
 法定代表人:郑毓栋
 电话:010-85643600
 联系人:姜娜
 客服电话:400-618-0707
 网址:www.hongdianfund.com
 (69)名称:上海联泰资产管理管理有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号2层310室
 办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8楼3层
 法定代表人:臧斌
 电话:021-52822663
 联系人:兰敏
 客服电话:400-166-6788
 网址:http://www.66zichan.com
 (70)名称:大泰金基金销售有限公司
 住所: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
 办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
 法定代表人:袁爽明
 电话:021-22267943
 联系人:朱真卿
 客服电话:400-928-2266
 网址:www.dtfunds.com
 (71)名称:一路财富(北京)信息科技股份有限公司
 住所:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
 办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
 法定代表人:吴雪涛
 电话:010-88312977
 联系人:徐越
 客服电话:400-010-1566
 网址:http://www.yilucaifu.com
 (72)名称:珠海盈米财富管理有限公司
 住所:珠海市横琴新区宝华路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12楼B1201-1203
 法定代表人:肖雯
 电话:020-88629099
 联系人:邵桐桐
 客服电话:020-89629066
 网址:www.yingmi.cn
 (73)名称:奕丰基金销售有限公司
 住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻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
 电话:0755-8946 0507;0755-8946 0500
 联系人:叶健
 客服电话:400-684-0500
 网址:www.ifastps.com.cn
 (74)名称:深圳市金斧子投资咨询有限公司
 住所:广东省深圳市南山区智荟广场A栋11层1101-02
 办公地址:广东省深圳市南山区科苑路16号东方科技大厦18楼
 法定代表人:鞠任宸
 电话:0755-84034499
 联系人:张萍
 客服电话:400-9302-888
 网址:www.jfzinv.com
 (75)名称:武汉市利嘉基金销售有限公司
 住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
 办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
 法定代表人:陶建
 电话:027-83863742
 联系人:陆锋

客服电话:400-027-9899
 网址:www.buyfundscn
 (76)名称:上海万得基金销售有限公司
 住所: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
 电话:021-50712782
 联系人:021-50710161
 客服电话:400-821-0203
 网址:www.52fund.com.cn
 (77)名称:深圳富济基金销售有限公司
 住所:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
 办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室
 法定代表人:刘鹏宇
 电话:0755-83999907-819
 联系人:刘勇
 客服电话:0755-83999907
 网址:www.jinqianwo.cn
 (78)名称:北京微动利基金销售有限公司
 住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商务楼341室
 办公地址:北京市石景山区古城西路113号3层341-342室
 法定代表人:梁洪军
 电话:010-52609666
 联系人:李长军
 客服电话:400-188-5687
 网址:www.huoyiforyou.com.cn
 (79)名称:北京亿金鑫基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号36层3603室
 办公地址:北京市东城区朝门内大街8号富华大厦B座12层B室
 法定代表人:程刚
 电话:010-56176118
 联系人:张旭
 客服电话:400-100-3391
 网址:www.dlianyingfund.com
 (80)名称:北京汇成基金销售有限公司
 住所:北京市海淀区中关村大街11号1111108室
 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号111108室
 法定代表人:王俐刚
 电话:010-62680527
 联系人:丁向冲
 客服电话:400-619-9069
 网址:www.hcjin.com
 (81)名称:北京展 vista 下投资管理有限公司
 住所:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村736号03室
 办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21&28层
 法定代表人:李浩
 电话:400-818-8866
 联系人:徐晓荣/刘慧慧
 客服电话:010-58170876
 网址:www.shengshiview.com.cn
 (82)名称:上海基煜基金销售有限公司
 住所: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)
 办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
 法定代表人:王刚
 电话:021-65370077
 联系人:吴鸿飞
 客服电话:400-820-5369
 网址:www.jiyufund.com.cn
 (83)名称:天津万家财富资产管理有限公司
 住所: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:李峰
 电话:010-59013825
 联系人:王芳芳
 客服电话:010-59013842
 网址:www.wanjiawealth.com
 (103)名称:通华财富(上海)基金销售有限公司
 住所:海虹口区同丰路667弄107号201室
 办公地址:上海市浦东新区金沪路65号通华科技大厦7层
 法定代表人:马刚
 电话:021-60818588
 联系人:丁仪伟
 客服电话:95193转5
 网址:https://www.tonghuafund.com
 (二)注册登记机构
 名称:国联安基金管理有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
 法定代表人:于业明
 联系人:黄娜娜
 电话:021-39992857
 (三)出具法律意见书的律师事务所
 名称:上海市通力律师事务所
 注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人:韩炯
 联系人:黎明
 电话:021-31358666
 传真:021-31358600
 经办律师:吕白、黎明
 (四)审计基金资产的会计师事务所
 名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
 注册地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
 办公地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
 负责人:蔡廷基
 联系人:黎俊文
 联系电话:021-58594666
 传真:021-62881889
 经办注册会计师:王国辉、陈彦君
 五、基金的投资
 国联安货币市场证券投资基金
 七、基金投资的目标
 在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式投资管理,定性分析与量化分析相结合,力争为投资者提供稳定的收益。
 八、基金的投资范围
 本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,具体如下:
 1、现金;
 2、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;
 3、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
 4、期限在1年以内(含1年)的银行承兑、同业存单;
 5、期限在1年以内(含1年)的债券回购;
 6、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
 7、中国证监会、中国人民银行认可的其它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的其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
 (一)投资策略
 本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测,在此基础上,确定组合久期和类别资产配置比例,把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择,具体包括以下策略:
 1、利率预期策略
 利率变化是影响债券价格的最重要的因素,所以利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化和短期资金供给等因素的分析,形成对未来短期利率走势的判断,并依此调整组合的期限和品种配置。如果预期利率下降,将增加组合的久期;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的久期。
 2、收益率曲线策略
 短期资金市场同债券市场紧密相关,连接两个市场的分析工具是收益率曲线。收益率曲线策略通过对债券市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时期内获取因收益率曲线形变而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在组合平均期限策略调整的基础上,本基金将比较不同的投资策略,例如分拆子期限策略、杠铃策略和梯形策略等在不同市场环境下的表现,构建优化组合获取市场收益。
 3、类属配置策略
 在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具(国债、金融债、央行票据、回购等)的市场环境、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例,再通过评估各类资产的流动性和收益性利率差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。
 4、现金流管理策略
 根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作将债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持本基金充分流动性的基础上争取较高收益。
 5、套利策略
 套利策略包括正回购与银行同业存款之间的套利、正回购与逆回购之间的套利、跨市场套利和跨期限套利。
 正回购与银行同业存款之间的套利,指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后,再以金融同业存款利率存放银行,从而获得收益。正回购与逆回购之间的套利包括异日正回购与逆回购之间的套利和同日正回购与逆回购之间的套利。
 同一市场异日正回购与逆回购之间的套利,指的是在同一市场第T天以低于金融同业存款利率的价格融入资金,而在T+1后选定的交易日以高于金融同业存款利率的价格融出资金,从而获取收益。
 同日正回购与逆回购之间的套利,指的是第T天以低于金融同业存款利率的价格融入资金,同时在当天以高于金融同业存款利率的价格在同一品种上融出资金,从而获取收益。
 跨市场套利是指根据短期金融工具在各个细分市场的不表现进行套利。比如当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时,可以通过增加交易所市场回购的配置比例,或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。
 跨期限套利是指较长足货币市场投资平均剩余期限的条件下,较短回购利率低于预期回购利率时,在既定的变现率水平下,可通过增加较长长期回购的配置比例,或进行较短短期融资、较长长期融券而实现跨期限套利。
 6、个券选择策略
 根据上述资产配置要求,积极发掘价格被低估的且符合流动性要求的适合投资品种。通过分析各个具体金融产品的剩余期限与收益率差的对比状况、信用评级状况、流动性指标等因素进行证券选择,选择风险收益比最合理的证券作为投资对象。具体而言,个券选择遵循以下一些原则:
 (1)符合前述资产配置策略;
 (2)寻求短期内在价值被低估的个券;
 (3)寻求具有套利空间的个券;
 (4)符合风险管理指标,包括VAR和流动性指标的要求;
 (5)优先选择双边报价市场债券品种中的个券;
 (6)优先选择央行公开市场操作的个券。
 (二)投资决策流程
 1、投资依据
 有关法律、法规、基金合同等的相关规定。

办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
 法定代表人:张冠宇
 电话:010-85934903
 联系人:王田
 客服电话:400-819-9968
 网址:www.tdyhfund.com
 (97)名称:北京肯特瑞基金销售有限公司
 住所:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院E座
 办公地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
 法定代表人:江卉
 电话:13810801527
 联系人:韩楠星
 客服电话:400-088-8816
 网址:kenterui.jf.com
 (98)名称:民商基金销售(上海)有限公司
 住所:上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室
 办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
 法定代表人:贺惠忠
 电话:021-50260003
 联系人:杨一新
 客服电话:021-50260603
 网址:http://www.msifsc.com
 (99)名称:上海华夏财富投资管理有限公司
 住所: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:毛淮平
 电话:010-88066632
 联系人:仲秋玥
 客服电话:400-817-5666
 网址:www.amcfortune.com
 (100)名称:诺正投资(上海)基金销售有限公司
 住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号7224室
 办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋
 法定代表人:汪静波
 电话:15618885038
 联系人:余翼飞
 客服电话:400-821-5399
 网址:www.noah-fund.com
 (101)名称:上海大智慧基金销售有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
 法定代表人:申健
 电话:021-20219988-35328
 联系人:宋楠
 客服电话:021-20292031
 网址:www.wg.com.cn
 (102)名称:天津万家财富资产管理有限公司
 住所: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:李峰
 电话:010-59013825
 联系人:王芳芳
 客服电话:010-59013842
 网址:www.wanjiawealth.com
 (103)名称:通华财富(上海)基金销售有限公司
 住所:海虹口区同丰路667弄107号201室
 办公地址:上海市浦东新区金沪路65号通华科技大厦7层
 法定代表人:马刚
 电话:021-60818588
 联系人:丁仪伟
 客服电话:95193转5
 网址:https://www.tonghuafund.com
 (二)注册登记机构
 名称:国联安基金管理有限公司
 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼
 法定代表人:于业明
 联系人:黄娜娜
 电话:021-39992857
 (三)出具法律意见书的律师事务所
 名称:上海市通力律师事务所
 注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人:韩炯
 联系人:黎明
 电话:021-31358666
 传真:021-31358600
 经办律师:吕白、黎明
 (四)审计基金资产的会计师事务所
 名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
 注册地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
 办公地址:上海市静安区南京西路1266号恒隆广场50楼
 负责人:蔡廷基
 联系人:黎俊文
 联系电话:021-58594666
 传真:021-62881889
 经办注册会计师:王国辉、陈彦君
 五、基金的投资
 国联安货币市场证券投资基金
 七、基金投资的目标
 在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式投资管理,定性分析与量化分析相结合,力争为投资者提供稳定的收益。
 八、基金的投资范围
 本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,具体如下:
 1、现金;
 2、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;
 3、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
 4、期限在1年以内(含1年)的银行承兑、同业存单;
 5、期限在1年以内(含1年)的债券回购;
 6、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
 7、中国证监会、中国人民银行认可的其它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的其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
 (一)投资策略
 本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测,在此基础上,确定组合久期和类别资产配置比例,把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择,具体包括以下策略:
 1、利率预期策略
 利率变化是影响债券价格的最重要的因素,所以利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化和短期资金供给等因素的分析,形成对未来短期利率走势的判断,并依此调整组合的期限和品种配置。如果预期利率下降,将增加组合的久期;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的久期。
 2、收益率曲线策略
 短期资金市场同债券市场紧密相关,连接两个市场的分析工具是收益率曲线。收益率曲线策略通过对债券市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时期内获取因收益率曲线形变而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在组合平均期限策略调整的基础上,本基金将比较不同的投资策略,例如分拆子期限策略、杠铃策略和梯形策略等在不同市场环境下的表现,构建优化组合获取市场收益。
 3、类属配置策略
 在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具(国债、金融债、央行票据、回购等)的市场环境、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例,再通过评估各类资产的流动性和收益性利率差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。
 4、现金流管理策略
 根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作将债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持本基金充分流动性的基础上争取较高收益。
 5、套利策略
 套利策略包括正回购与银行同业存款之间的套利、正回购与逆回购之间的套利、跨市场套利和跨期限套利。
 正回购与银行同业存款之间的套利,指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后,再以金融同业存款利率存放银行,从而获得收益。正回购与逆回购之间的套利包括异日正回购与逆回购之间的套利和同日正回购与逆回购之间的套利。
 同一市场异日正回购与逆回购之间的套利,指的是在同一市场第T天以低于金融同业存款利率的价格融入资金,而在T+1后选定的交易日以高于金融同业存款利率的价格融出资金,从而获取收益。
 同日正回购与逆回购之间的套利,指的是第T天以低于金融同业存款利率的价格融入资金,同时在当天以高于金融同业存款利率的价格在同一品种上融出资金,从而获取收益。
 跨市场套利是指根据短期金融工具在各个细分市场的不表现进行套利。比如当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时,可以通过增加交易所市场回购的配置比例,或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。
 跨期限套利是指较长足货币市场投资平均剩余期限的条件下,较短回购利率低于预期回购利率时,在既定的变现率水平下,可通过增加较长长期回购的配置比例,或进行较短短期融资、较长长期融券而实现跨期限套利。
 6、个券选择策略
 根据上述资产配置要求,积极发掘价格被低估的且符合流动性要求的适合投资品种。通过分析各个具体金融产品的剩余期限与收益率差的对比状况、信用评级状况、流动性指标等因素进行证券选择,选择风险收益比最合理的证券作为投资对象。具体而言,个券选择遵循以下一些原则:
 (1)符合前述资产配置策略;
 (2)寻求短期内在价值被低估的个券;
 (3)寻求具有套利空间的个券;
 (4)符合风险管理指标,包括VAR和流动性指标的要求;
 (5)优先选择双边报价市场债券品种中的个券;
 (6)优先选择央行公开市场操作的个券。
 (二)投资决策流程
 1、投资依据
 有关法律、法规、基金合同等的相关规定。

2、投资管理体制
 本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金投资团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;决定重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。
 3、投资程序
 (1)投资决策委员会制定整体投资策略。
 (2)基金经理根据自身或者其他研究机构的研究成果,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供资产配置、投资决策支持。
 (3)基金经理根据投资决策委员会的投资战略,在研究部门研究报告的指引下,结合对宏观经济和市场状况的分析,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、类属配置、品种配置和调整方案。
 (4)交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理。
 (5)风险管理部,数量策略部定期进行基金风险评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。
 (6)风险管理部对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,重点关注基金投资组合的风险状况,并控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。
 (7)本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。
 十、基金的投资业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。七天通知存款具有存期灵活、存取方便的特点,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金作为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征,这些特征与七天通知存款的特征较为接近,因此,以同期七天通知存款利率具有透明、权威的特点,鉴于此,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。
 如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以根据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。
 十一、基金的风险收益特征
 本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。
 十二、基金的投资组合情况
 本基金管理人的董事会及董事保证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。
 本基金的托管人——上海浦东发展银行股份有限公司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、误导性陈述或重大遗漏。本报告投资组合报告所载数据截至2018年12月31日止,本报告财务资料未经审计师审计。

单元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,110,508,491.60	45.52
	其中:债券	5,110,508,491.60	45.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,969,514,604.26	26.45
	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	2,750,054,786.05	24.49
4	其他资产	386,011,321.52	3.54
5	合计	11,228,089,203.43	100.00

2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.15	
	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	报告期内债券回购融资余额	-	-
	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
 本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。
 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
 本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过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	46.42	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	5.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	96.93	0.00

4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明
 本报告期内,本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过240天的情况。
 5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	69,616,643.23	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	490,615,354.59	4.37
	其中:政策性金融债	490,615,354.59	4.37
4	企业债券	-	-
5	中期票据	291,020,157.34	2.59
6	同业存单	4,289,256,338.44	37.94
7	其他	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,110,508,491.60	45.53
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	111833354	18广发银行CD157	5,000,000	497,380,437.58	4.43
2	11180621	18交通银行CD216	4,000,000	396,722,510.61	3.53
3	11181834	18华夏银行CD342	3,000,000	298,437,390.04	2.66
4	11180403	18中国光大CD208	3,000,000	298,231,547.65	2.66
5	11180942				