

国寿安保薪金金宝货币市场基金更新招募说明书摘要

(2019年第2号)

国寿安保薪金金宝货币市场基金(以下简称“本基金”)根据2014年11月5日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予国寿安保薪金金宝货币市场基金注册的批复》(证监许可[2014]1174号)注册和2014年11月13日《关于国寿安保薪金金宝货币市场基金募集时间安排的确认函》(证监基金字[2014]1769号),进行募集。本基金的基金合同于2014年11月20日生效。本基金为契约型开放式基金。

重要提示

国寿安保基金管理有限公司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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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。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。

本基金的基金合同于2014年11月20日生效。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金投资于货币市场,每万份基金已实现收益、7日年化收益率会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不能保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等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、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人及基金管理人实施过程中产生的基金运作风险、本基金的特有风险等等。本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。投资有风险,投资人认购(或申购)基金前应认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面了解本基金的投资目标、基金产品特性,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险等,由投资人自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

本更新招募说明书所载内容截止日为2019年6月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国寿安保基金管理有限公司

住所:上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人:王军辉

设立日期:2013年10月29日

注册资本:12.88亿元人民币

存续期间:持续经营

客户服务电话:4009-258-258

联系人:耿馨雅

国寿安保基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监许可[2013]1306号文核准设立,公司股东为中国人寿资产管理有限公司,持有股份85.03%;AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(安资本投资管理有限公司),持有股份14.97%。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事会成员

王军辉先生,董事长,博士。曾任嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理兼投资部总监、投资决策委员会执行委员,中国人寿资产管理有限公司总裁助理、副总裁、党委委员,国寿投资控股有限公司总裁、党委书记,现任中国人寿保险(集团)公司首席投资官,中国人寿资产管理有限公司总裁、党委书记,国寿安保基金管理有限公司董事长,中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事长。

宋子洲先生,董事,本科。曾任中国人寿保险(集团)公司资金运用中心副总经理,并曾在中央国家机关和中国外贸运输(集团)公司工作。现任中国人寿资产管理有限公司党委委员、副总裁,中国保险资产管理业协会副会长、东吴证券股份有限公司董事。

左季庆先生,董事,硕士。曾任中国人寿资金运用中心债券投资部总经理助理,中国人寿资产管理有限公司债券投资部总经理助理、总经理,中国人寿资产管理有限公司固定收益部总经理,并担任中国交易商协会债券专家委员会副主任委员;现任国寿安保基金管理有限公司总经理、国寿财富管理有限公司董事长。

叶蕾女士,董事,硕士。曾任中华全国工商业联合会国际联络部副处长;现任澳大利亚安保集团北京代表处首席代表、中国人寿养老保险股份有限公司董事、国寿财富管理有限公司监事。

罗璐女士,独立董事,博士。曾任武汉造船厂专用设备厂助理工程师,华中科技大学管理学院讲师、博士后,武汉大学经济与管理学院金融系副教授。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师,《经济评论》副主编,教育部新世纪优秀人才支持计划入选者,南昌农商银行独立董事,深圳财富趋势科技股份有限公司独立董事。

杨金观先生,独立董事,硕士。曾任中央财经大学教务处处长、会计学院党总支书记兼副院长;现任中央财经大学会计学院教授。

周黎安先生,独立董事,博士。曾任北京大学光华管理学院副教授;现任北京大学光华管理学院应用经济系主任、教授。

2.基金管理人监事会成员

杨建海先生,监事长。曾任中国人寿保险(集团)公司办公室综合处副处长,中国人寿保险(集团)公司办公室总务处处长,中国人寿资产管理有限公司办公室副主任、监审部副总经理(主持工作),中国人寿资产管理有限公司纪委副书记、股东代表监事、监审部总经理、办公室主任;现任中国人寿资产管理有限公司风险管理与合规部总经理。

张彬女士,监事,硕士。曾任毕马威华振会计师事务所审计员、助理经理、经理、高级经理及部门负责人;现任国寿安保基金管理有限公司合规管理部总经理。

马胜强先生,监事,硕士。曾任中国人寿资产管理有限公司人力资源部助理、业务主办;现任国寿安保基金管理有限公司综合管理部助理。

3.高级管理人员

王军辉先生,董事长,博士。简历同上。

左季庆先生,总经理,硕士。简历同上。

申梦玉先生,督察长,硕士。曾任中国人寿保险(集团)公司资金运用中心基金投资部副总监,中国人寿资产管理有限公司交易管理部高级经理,中国人寿资产管理有限公司风险管理与合规部副总经理(主持工作);现任国寿安保基金管理有限公司督察长,国寿财富管理有限公司董事。

石伟先生,资产配置总监,学士。曾任兴全基金公司固定收益首席投资官兼固收总监、中国人寿资产管理有限公司固定收益部副总经理(主持工作);现任国寿安保基金管理有限公司资产配置总监及投资管理二部总经理。

张琦先生,股票投资总监,硕士。曾任中银基金管理有限公司基金经理、基金经理助理;现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监及基金经理。

董瑞倩女士,固定收益投资总监,硕士。曾任工银瑞信基金管理有限公司专户投资部基金经理,中银国际证券有限责任公司固定收益部副总经理、执行总经理;现任国寿安保基金管理有限公司固定收益投资总监、投资管理部总经理及基金经理。

王文英女士,总经理助理,硕士。曾任中国人寿保险(集团)公司财务主管,中国人寿资产管理有限公司财务会计经理,国寿安保基金管理有限公司综合管理部副总监、总经理;现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理、综合管理部总经理。

王福新先生,总经理助理,博士后。曾任中国海洋大学教师、大公网国际资信评估有限公司金融机构部副经理、中国人民财产保险股份有限公司博士后工作站研究员,中国人寿保险股份有限公司内控合规部高级主管、投资管理部评估分析处经理、人民币投资管理处高级经理、委托投资管理一处资深经理;现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

大明先生,总经理助理,硕士MBA。曾任华安基金管理有限公司零售业务总部总经理、上海丰佳集团罗马尼亚EVERFRESH公司总经理、巨田证券有限公司客户部职员。现任国寿安保基金管理有限公司总经理助理。

4.本基金基金经理

桑迎先生,基金经理,硕士。2002年7月至2003年8月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年1月至2008年1月,任职于华夏银行总行资金部,担任交易员;2008年2月至2013年12月,任职于嘉实基金,历任交易员、基金经理。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,2014年10月起任国寿安保场内实时申赎货币市场基金基金经理,2014年11月起任国寿安保薪金金宝货币市场基金基金经理,2015年3月起任国寿安保聚宝益货币市场基金基金经理,2015年10月起任国寿安保鑫钱包货币市场基金基金经理,2016年12月起任国寿安保添利货币市场基金基金经理,2018年3月起任国寿安保货币市场基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

张琦先生:国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监。

董瑞倩女士:国寿安保基金管理有限公司固定收益投资总监、投资管理部总经理。

殷辰菊女士:国寿安保基金管理有限公司研究部总经理。

黄力:国寿安保基金管理有限公司基金经理。

桑迎:国寿安保基金管理有限公司基金经理。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

名称:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)

住所:北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人:李庆萍

成立时间:1987年4月20日

组织形式:股份有限公司

注册资本:4,899.35亿元人民币

存续期间:持续经营

批准设立文号:中华人民共和国国务院令(1987)114号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号

联系人:中信银行资产托管部

联系电话:4006800000

传真:010-85230024

客服电话:95558

网址:bank.citic.com

经营范围:保险兼营代理业务(有效期至2020年09月09日);吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代

理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资业务、企业年金基金、保险业务、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。(企业依法自主选择经营项目,开展经营活动;依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动;不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。)

中信银行(601988.SH、0398.HK)成立于1987年,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外,为中国经济建设做出了积极贡献。2007年4月,中信银行实现在上海证券交易所和香港联合交易所A+H股同步上市。

中信银行以建设最佳综合金融服务企业为发展愿景,充分发挥中信集团金融与实业并举的独特竞争优势,坚持“以客户为中心”,秉承“平安中信、合规经营、科技立行、服务实体、市场导向、创造价值”的经营理念,向企业客户和机构客户提供公司银行业务、国际业务、金融市场业务、机构业务、投资银行业务、保理业务、托管业务等综合金融解决方案,向个人客户提供零售银行、信用卡、消费金融、财富管理、私人银行、出国金融、电子银行等多元化金融产品及服务,全方位满足企业、机构及个人客户的综合金融服务需求。

截至2018年末,中信银行在国内146个大中城市设有1,410家营业网点,同时在境内外下设6家附属公司,包括中信国际金融控股有限公司、信银(香港)投资有限公司、中信金融租赁有限公司、浙江临安中信村镇银行股份有限公司、中信百信银行股份有限公司和阿含金银行。其中,中信国际金融控股有限公司子公司中信银行(国际)有限公司,在香港、澳门、纽约、洛杉矶、新加坡和中国内地设有38家营业网点。信银(香港)投资有限公司在香港和中国内地设有3家子公司。中信百信银行股份有限公司由中信银行与百度公司发起设立的国内首家具有独立资质的直销银行。阿尔金银行在哈萨克斯坦设有6家营业网点和1个私人银行中心。

30多年来,中信银行坚持服务实体经济、稳健经营,与时俱进。经过30余年的发展,中信银行已成为一家总资产规模超6万亿元、员工人数近9万名,具有强大综合实力 and 品牌竞争力的金融集团。2018年,中信银行在英国《银行家》杂志“全球银行品牌500强排行榜”中排名第24位;中信银行一级资本在英国《银行家》杂志“世界1000家银行排名”中排名第27位。

(二)主要业务情况

方英豪先生,中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入中信银行董事会。方先生自2014年8月起任中信银行党委委员,2014年11月起任中信银行副行长,2017年1月起兼任中信银行财务总监,2019年2月起任中信银行党委副书记。方先生现同时担任信银(香港)投资有限公司、中信银行(国际)有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前,方先生于2013年5月至2015年1月任中信银行金融市场业务总监,2014年5月至2014年9月兼任中信银行杭州分行党委书记、行长;2007年3月至2013年5月任中信银行苏州分行党委书记、行长;2003年9月至2007年3月历任中信银行杭州分行行政助理、党委委员、副行长;1996年12月至2003年9月在中信银行杭州分行工作,历任信贷部科长、副总经理,富阳支行行长、党组书记,国际结算部副总经理,零售业务部副总经理,营业部总经理;1996年7月至1996年12月任浦东发展银行杭州城东办事处副主任;1992年12月至1996年7月在浙江银行学校实验城市信用合作信贷部工作,历任信贷员、经理、总经理助理;1991年7月至1992年12月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师,毕业于北京大学,获高级管理人员工商管理硕士学位,拥有二十余年中国银行业从业经验。

杨敏女士,中信银行副行长、分管托管业务。杨先生自2015年7月起任中信银行党委委员,2015年12月起任中信银行副行长。此前,杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长;2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长;1982年8月至2006年6月在中国建设银行河南省分行工作,历任计财处副处长,信阳分行副行长、党委委员,计财处处长,郑州市铁道分行党委书记、行长,郑州分行党委书记、行长,河南省分行党委副书记、副行长(主持工作)。方先生为高级经济师,研究生学历,管理学博士。

陈路珈女士,中信银行资产托管部副总经理,代为履行部门负责人职责,硕士研究生学历。陈女士2014年5月至今历任中信银行资产托管部总经理、副副总经理;2007年6月至2014年5月在中国光大银行上海分行工作,历任公司业务二部副总经理,长兴岛支行行长,公司业务管理部总经理,投行业务部总经理;2002年12月至2007年6月在海BC Bank PLC工作。

(三)基金托管业务经营情况

2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2019年一季度末,中信银行托管138只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODI等其他托管资产,托管总规模达到18.62万亿元人民币。

三、相关服务机构

(一)基金发售代理机构

1.直销机构

(1)国寿安保基金管理有限公司直销中心

名称:国寿安保基金管理有限公司

住所:上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人:王军辉

客户服务电话:4009-258-258

传真:010-50850777

联系人:孙璐

(2)国寿安保基金管理有限公司网上直销系统(https://www.gsffunds.com.cn/etrading/)

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销售机构销售本基金,并及时公告。

2.其他销售机构

(1)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号东方文化大厦北楼

法定代表人:李庆萍

联系人:迟卓

电话:010-89937333

传真:010-85230049

客户服务电话:95558

网址:www.citicbank.com

(2)中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈共炎

联系人:邵海霞

电话:010-66561814

传真:010-66568990

客户服务电话:95551

网址:www.chinastock.com.cn

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销售机构销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构

名称:国寿安保基金管理有限公司

住所:上海市虹口区丰镇路806号3幢306号

办公地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11、12层

法定代表人:王军辉

客户服务电话:4009-258-258

传真:010-50850966

联系人:于晓树

(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:俞卫锋

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:安冬

经办律师:安冬、孙睿

(四)会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址: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

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

执行事务合伙人:毛贻尊

电话:010-58153000

传真:010-58188298

联系人:范新繁

经办注册会计师:黄悦松、郭燕、范新繁、张小东、范玉军、夏欣然

四、基金名称

国寿安保薪金金宝货币市场基金

五、基金的类型

货币型

六、基金的投资目标

在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。

七、投资范围

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:

(一)现金;

(二)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;

(三)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;

(四)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。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,不需召开基金份额持有人大会。

八、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,对基金资产进行组合配置积极管理。

(一)资产配置策略

基金管理人主要采取自上而下的方式,通过对宏观经济和资本市场进行深入研究,综合考虑市场流动性特征、存款银行的信用资质、信用债信用评级及其他资产的收益率水平和流动性特征,设定各类资产合理的配置比例。

(二)利率预期策略

由于短期利率对于基金资产有重要影响,基金管理人将持续跟踪分析货币市场短期利率变化,以根据形势变化对基金资产做出合理调整。

具体而言,基金管理人将持续跟踪分析宏观经济及流动性等指标,在对宏观经

济走势、流动性状况及宏观经济政策进行深入分析基础上,准确把握短期利率走势并做出及时反应。一般说来,预期利率上涨时,将适当缩短组合的平均剩余期限;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。在短期利率期限结构分析和品种深入分析的基础上,进行品种和合理配置。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。

(三)利率品种投资策略

基金管理人将对国内外宏观经济形势研究基础上,对利率期限结构和债券市场变化趋势进行深入分析和预测,基于利率品种的收益风险特征调整债券组合久期。确定组合平均久期后,运用量化分析技术,选择合理的期限结构的配置策略。

(四)信用品种投资策略

基金管理人参考外部信用评级结果,在公司内部的信用评级体系基础上,对市场公开发行的所有短期融资券、中期票据、企业债、公司债等信用品种进行认真筛选和筛选,形成信用品种基础池,结合本基金的配置需要,通过对到期收益率、剩余期限、流动性等综合分析,挑选适合的短期信用品种进行投资。

(五)银行定期存款投资策略

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,通过向交易对手询价基础上,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款的投资,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。

(六)杠杆投资策略

基金管理人将在严格遵守杠杆比例的前提下,通过对流动性状况深入分析,综合比较回购利率与短期债券收益率、存款利率,判断是否存在利差套利空间,进而确定是否进行杠杆操作。

(七)流动性管理策略

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。

本基金将通过对市场结构、市场冲击情况、主要资产流动性变化跟踪分析等多种方式对流动性进行定量定性分析,在进行组合优化时增加流动性约束条件,在兼顾流动性的前提下合理控制资产的流动性风险,综合平衡基金资产在证券类资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性券种、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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:7天通知存款利率(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7天通知存款利率(税后)作为业绩比较基准。7天通知存款利率由中国人民银行公布,如7天通知存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从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,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险预期和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人、基金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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的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,报告期间为2018年7月1日至9月30日。本报告财务数据未经审计。

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	14,674,643,929.75	39.19
	其中:债券	14,674,643,929.75	39.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,165,722,708.58	3.11
	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	21,467,012,928.07	57.34
4	其他资产	133,623,238.62	0.36
5	合计	37,441,002,806.02	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	135.3	
	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	报告期内债券回购融资余额	3,084,138,697.91	8.96
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日基金资产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:

本基金本报告期内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

(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	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	100

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	27.14	8.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	15.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	0.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	50.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.68	8.96

4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.报告期末按资产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	129,687,221.24	0.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,788,111,968.38	5.21
	其中:政策性金融债	1,788,111,968.38	5.21
4	企业债券	301,486,904.06	0.88
5	企业短期融资券	4,061,549,088.81	11.80
6	中期票据	523,242,195.92	1.52
7	同业存单	7,880,566,481.34	22.96
8	其他	-	-
9	合计	14,674,643,929.75	42.75
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	111906042	19交通银行CD042	10,000,000	996,761,630.75	2.90
2	111918066	19华夏银行CD066	10,000,000	996,760,882.15	2.90
3	111916018	19上海银行CD018	8,000,000	798,912,913.18	2.33
4	111912042	19广发银行CD042	7,000,000	695,690,844.50	2.03
5	11189676	18成都银行CD237	5,000,000	497,427,356.06	1.45
6	111811240	18平安银行CD240	5,000,000	489,631,112.02	1.45
7	111900339	19中信银行CD039	5,000,000	496,922,031.79	1.45
8	011802038	18国债逆回购02	4,000,000	400,220,688.50	1.17
9	111805209	18建设银行CD209	4,000,000	397,728,069.63	1.16
10	091718001	17广发债001	3,800,000	384,633,602.92	1.12

7、“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	0.06%
报告期内偏离度的最低值	0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内,本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。