

(上接B055版)

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6F
法人代表:陈柏青
客服电话:0571-26888888
联系人:陈皓彬
客服电话:400-0766-123
网址:www.fund123.cn
(83)上海天基基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C层9楼
法定代表人: 其实
电话:186-1170-5311
联系人: 丁珊珊
客户服务热线:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn
(94)上海好望基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区南汇新城滴水湖1118号鄂尔多斯国际大厦9楼(201210)
法定代表人:杨文斌
电话:13661870024
联系人: 徐福强
客服电话:400-700-9606
网址:www.ehowbuy.com
(95)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1号903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路5号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
电话:13678861499
联系人:吴斌
客服电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com
(86)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:1521006161
联系人:张洪波
客服电话:010-85657576
网址:www.lianike.com
(87)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
联系人:王昀
客服电话:15221808925
联系人:李莉
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(88)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋岗社区HALO广场4楼
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
联系人:黄江江
客服电话:400-6788-887
网址:www.zlfund.com及www.jimw.com
(89)北京恒信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路17号恒信大厦1001室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路17号恒信大厦1001室
法定代表人:孙斌
电话:010-59601366-7024
联系人:刘静
客服电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com
(90)珠海米跃资产管理有限公司
注册地址: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
法人代表:肖雯
电话:1392214111
联系人:黄薇娟
客服电话:020-89629066
网址:www.yimicm.com
(91)上海融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
法人代表:郭奕
电话:15921301165
联系人:胡月
客服电话:400-096-6618
网址:www.lu.com
(92)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区技术开发区宏达北路10号5层1222室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法人代表:梁越
电话:13810678503
联系人:陈婉钰
客服电话:400-899-0818
网址:www.chtfund.com
(93)上海长量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路565号裕阳国际B座16层
法人代表:陈伟杰
电话:021-20691832
联系人:曹苗苗
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
(94)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:北京市朝阳区宣武门外大街甲一号环球金融中心A座5层
法人代表:安宇
电话:010-59336519
联系人:孙雯
客服电话:010-59336512
网址:www.jnlc.com
(95)北京点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东路11号院1号楼1602室
办公地址:北京市朝阳区望京亚奥中心B座裙楼二层
法人代表:胡仕倩
电话:18613699656
联系人:陈婉洁
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimu.com
(96)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法人代表:赵学军
电话:010-60842306
联系人:李雯
客服电话:400-021-19850
网址:www.harvestwm.cn
(97)北京景景基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号丹棱soho1008-1012
法人代表:赵春春
电话:18601260851
联系人:陈海娟
客服电话:400-893-6885
网址:www.dxyw.com
(98)泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海湾中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海湾中龙园3号
法定代表人:林卓
电话:1904000358
联系人:徐福慧
客服电话:400-641-1999
网址:www.taichengziben.com
(99)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法人代表:林义相
电话:010-66045608
联系人:赵彦芳
客服电话:010-66045655
网址:www.txsec.com
(100)北京加和基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼5层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲120号文化创意园二期404
法人代表:徐福星
电话:13811665981
联系人:李刚
客服电话:400-600-0030
网址:www.baijiafund.com
(101)深圳前海华信基金销售有限公司
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:深圳市南山区高新南二路12号建恒集团二期418室
法人代表:李贤贺
电话:0755-83999007-806
联系人:刘勇
客服电话:0755-83999007
网址:www.jinjiawin.com
(102)北京南顺恒信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼泰康金融大厦38层
法人代表:张廷宇
电话:010-85932810
联系人:王丽娟
客服电话:400-819-9888
网址:www.nhfund.com.cn
(103)上海汇付基金销售有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市徐汇区虹梅路181号凯创国际大厦7楼
法人代表:冯修敏
电话:18901713632
联系人:甄妮林
电话:021-34013996
网址:www.huijifund.com
(104)深圳市华兰证券投资管理咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区德胜门外大街28号富卓大厦16层
法人代表:杨蕾
电话:18602364567
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
网址:rl.jiayun.cn
(105)上海中正达广基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙漕路2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙漕路2815号302室
法人代表:周欣
电话:021-32529592
联系人:戴珉婧
客服电话:400-676-6753
网址:www.zzhzfund.com
(106)大泰基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路369号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:南京市建邺区江东中路222号奥体中心文体创业园
法人代表:陆桐
电话:021-22279794
联系人:赵明
客服电话:400-29-2266
网址:www.dttzfund.com
(107)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元212207
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元212207
法人代表:熊斐斐

电话:15010450237
网址:www.kcczq.com.cn
客服电话:400-061-8518
网址:www.ncfj.com
(108)泰信财富投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8909房间
办公地址:北京市朝阳区建国路99号世纪财富大厦C座8层
法定代表人:李志强
电话:13601264918
联系人:李洪涛
电话:400-881-5696
网址:www.taixincn.com
(109)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦10楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号10楼12楼
法人代表:沈继伟
电话:18901780806
联系人:陈洁
客服电话:400-021-7733
网址:www.lidaiBank.com.cn
(110)上海聚基基金销售有限公司
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:上海市市长宁区福泉北路181号8层3层
法人代表:秦斌
电话:021-52822063
联系人:陈东
客服电话:400-046-6788
网址:www.jujifund.com
(111)北京前海开源基金管理有限公司
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:北京市海淀区西四环北路58号理想国际大厦906室
办公地址:北京市海淀区中关村海淀北2街10号泰康大厦12楼
联系人:张帆
电话:18611736339
联系人:李博
客服电话:010-62676979
网址:www.pohopen.com.cn
(112)北京鹏鼎基金销售有限公司
注册地址:北京市石景山区八大处高科技中心西十号院1111号
办公地址:北京市朝阳区西惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人:许良辰
电话:010-56080280
联系人:李博
客服电话:400-150-0882
网址:www.lanmao.com/mymoney
(113)北京广润达信投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区新街外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼瑞颂中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
电话:15201598214
联系人:王磊
客服电话:400-623-6060
网址:www.guanfund.com
(114)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区福安路196号1楼701室
办公地址:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
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:高辉
电话:0755-83665888-605
联系人:廖嘉琦
客服电话:400-082-8688
网址:www.foresakenyes.com
(115)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
电话:021-68882280
联系人:徐亚丹
客服电话:400-820-9463
网址:www.wind.com.cn
(116)浦领基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层909室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层904-06
法定代表人:李相喜
电话:13611266407
联系人:李博
客服电话:400-059-8888
网址:www.yufund.com
(117)北京特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区经济技术开发科创十一街18号C座2221室
办公地址:北京市朝阳区经济技术开发科创十一街18号C座2222室
法定代表人:陈超
电话:18612439949
联系人:黄立彭
客服电话:400-088-8816
网址:jt.fund.com.cn
(118)北京汇基基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街111号11层1109号
办公地址:北京市海淀区中关村大街111号11层1109号
法定代表人:王伟刚
电话:18001102931
联系人:丁珊珊
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzoo.com.cn
(119)官信晋洋投资管理(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号soho现代城C座18层1809
法定代表人:戎兵
电话:13620443582
联系人:张博群
客服电话:400-609-200
网址:www.yixinfund.com
(120)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
办公地址:深圳市南山区海德二路招商大厦1116室A1307室
法定代表人:TEO WEE HOWE
电话:13424294100
联系人:魏奇峰
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(121)北京创金启源投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区白纸坊东街1号2号楼215A
办公地址:上海市崇明县长兴镇东三路4号创金启源基金大厦615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1503-1504室
法定代表人:王刚
电话:17721005485
联系人:吴鸿飞
客服电话:400-820-5369
网址:www.ciqin.com.cn
(124)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:朝阳区东三环广外中街1号朝来高科技产业园5号楼
法定代表人:程刚
电话:18701236910
联系人:陈海娟
客服电话:400-810-5919
网址:www.fenghd.com
(125)申银万国期货有限公司
注册地址:上海市东方路900号7、8、10楼
办公地址:上海浦东新区东川路900号宝安大厦7、8、10楼
法定代表人:李建中
联系人:安雯雯
电话:13601050901
客服电话:400-988-7988
网址:www.sywgw.com
(126)乾道盈泰基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街1号院1号楼717室
办公地址:北京市西城区德胜门外大街合生财富广场161302室
法定代表人:王吉普
联系人:张林
电话:18810297881
客服电话:400-898-8080
网址:www.qiandaojr.com
(127)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技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕薇
电话:0755-29330613
客服:400-930-0960
网址:www.jinjizw.com
(128)北京徽信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云区高碑店镇89号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠国国际大厦10层10号
法定代表人:杨晓飞
电话:18701368526
客服电话:4006-802-123
网址:www.huilin-fund.com
(129)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
办公地址:上海市黄浦区延安西路101号凯石大厦4F
法定代表人:陈茜武
联系人:高晓玲
电话:13891178416
客服电话:21-6333-3339-230
网址:www.vstonewealth.com
(130)杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州下城区天竺路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
电话:15926466590
联系人:袁晶晶
客服电话:0571-89655920
网址:www.cd121.com
(131)深圳前海信基基金销售有限公司
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
办公地址:大连市中山区南山路156号南1910-A3-1
法定代表人:冯升平
联系人:王洪臣
电话:13223006998
客服电话:4007-903-688
网址:www.tundfund.com
(132)江西鑫隆资产管理有限公
司
注册地址:江西省南昌市高新区莱阳大道绿地新都会38栋2107室
办公地址:江西省南昌市高新区莱阳大道3333号绿地新都会38栋2108室
法定代表人:陆雯
联系人:傅彦芳
电话:13879129841

客服:0791-96829590
网址:www.kcczq.com.cn
客服电话:400-061-8518
网址:www.ncfj.com
(133)上海海银永泰基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区张江路波场690号4号楼2楼
办公地址:上海市浦东新区张江路波场690号4号楼2楼
法定代表人:陈冰
联系人:陆雨婷
电话:15021063034
客服电话:400-998-7172
网址:www.99fund.com.cn
(134)嘉晟瑞信(天津)基金销售有限公司
注册地址:天津市南开区门外大街与服装街交口悦府广场1号楼2503室
办公地址:天津市南开区门外大街与服装街交口悦府广场1号楼2503室
法定代表人:孙伟
电话:15610946151
联系人:孙颖
客服:400-883-2993
网址:www.jxrcfund.com
(135)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道1-5号
办公地址:南京市玄武区玄武大道1-5号
法定代表人:张俊
电话:025-66966699-887225
联系人:王峰
客服电话:021-52082063
联系人:陈东
客服电话:400-046-6788
网址:www.jujifund.com
(136)上海好望基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路700号5层01.02.03室
(137)北京前海开源基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区西四环北路58号理想国际大厦906室
办公地址:北京市海淀区中关村海淀北2街10号泰康大厦12楼
法定代表人:张帆
电话:18611736339
联系人:李博
客服电话:010-62676979
网址:www.pohopen.com.cn
(138)天津万家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2-4213室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人:李俊峰
电话:13811914597
联系人:杨静
客服电话:400-020-13828
网址:www.wjasset.com
(139)洪泰财富(青岛)基金销售有限公司
注册地址:山东省青岛市香港东路196号1楼701室
办公地址:北京市西城区西什大街31号院1号楼文创新创601室
法定代表人:任筱楠
电话:13621172151
联系人:王慧博
客服电话:0532-66728591
网址:www.hongtaiwealth.com
(140)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:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦B座8层
法定代表人:毛伟平
电话:400-818-3367
联系人:张静怡
客服电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
(141)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风东路口、康宁街北6号6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路9号领创国际电子城3层
法定代表人:李振勇
电话:13810222517
联系人:董亚芳
客服电话:400-360-0000
网址:www.hgcfund.com
(142)博时财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同济路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场高南路799号3号楼9楼
法定代表人:马刚
电话:021-60810686
联系人:杨涛
客服电话:96156
网址:www.tonghuafund.com
(143)大禹国际基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街18号1层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街18号1层1108号
法定代表人:王志刚
电话:13810222517
联系人:董亚芳
客服电话:400-360-0000
网址:www.hgcfund.com
(144)博时财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同济路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场高南路799号3号楼9楼
法定代表人:马刚
电话:021-60810686
联系人:杨涛
客服电话:96156
网址:www.tonghuafund.com
(145)江苏林氏大基金销售有限公司
注册地址:南京市高淳区经济开发区古槐大道47号
办公地址:江苏省南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人:吴月华
电话:16621719488
联系人:黄子卿
客服电话:025-66604166
网址:www.linshidai.com
(146)玄元保险代理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马洁清
电话:13762528013
联系人:李羿博
客服电话:021-50701053
网:www.xyinsure.com/7100/kfzl_yxyh
(一)注册登记机构
名称:天弘基金管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号
办公地址:北京市朝阳区望京路5号天润国际经济贸易中心A座16层
法定代表人:井贤栋
电话:(022)83865560
传真:022-83865563
联系人:薄贺龙
(二)律师事务所和会计师事务所
名称:天津嘉德恒信律师事务所
住所:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座1009-1010
法定代表人:孟凡民
电话:(022)83865296
传真:022-83865296
联系人:续宏帆
经办律师:韩刚、续宏帆
(三)会计师事务所和注册消防工程师
名称:德华永道会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区张杨路202号普华永道中11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238800
经办注册会计师:薛爽、周伟
联系人:周伟
(一)基金份额分级
本基金根据投资者申购的金额等级,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费,因此形成不同的基金份额等级。本基金设A级、B级、C级、D级和E级五类基金份额,五类基金份额的销售服务费代码,并单独公布每万份基金净收益和七日年化收益率。
(二)基金份额的申购和赎回
投资者在申购本基金基金份额时,持有A级基金份额升级为B级基金份额,420106、C级基金份额的基金代码为000832、D级基金份额代码为001251、E级基金份额代码为002847。
根据基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人可对基金份额情况进行调整并公告。
(三)基金份额级别的限制
投资者可自行选择申购的基金份额级别,不同基金份额级别之间不得互相转换,但依据《基金合同》约定在申购、赎回而发生基金份额自动升级或降级的除外。
表1:基金份额分级的数量限制表
表2:基金份额分级的数量限制表
基金份额的最低金额限制及规则,基金管理人必须在至少开始销售之前2个工作日在一家指定媒体上刊登公告。
(三)基金份额的自动升降级
投资者在其同一账户下保留的A级基金份额超过600份(含)时,本基金的注册登记机构将其持有的基金份额升级为B级基金份额。
投资者在其同一账户下保留的B级基金份额最低余额为500份(含),否则本基金的注册登记机构自动将其持有的基金份额升级为A级基金份额。
C级基金份额、D级基金份额和E级基金份额持有基金份额升降级,基金管理人可以与基金托管人协商一致并在履行相关程序后,调整基金份额升降级的数量限制及规则,基金管理人必须在开始销售之前2个工作日至少在一家指定媒体上刊登公告。
五、基金的投资
六、基金的投资目标
本基金类别:货币市场基金
七、基金的投资目标
在保持基金资产的低风险和流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
八、基金的投资方向
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。
对于法律法规及监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具,基金管理人可根据法律法规和市场情况进行调整并公告。
九、基金的投资策略
1、资产配置策略
本基金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。在此基础上,根据不同类别资产的收益率水平,各资产配置比例,利息支付方式及再投资便利性,并结合各类资产的流动性特征(日均成交量、交易方式、市场流量)和风险控制(利率敏感性、流动性)的变动,动态调整资产配置比例和期限匹配。
2、个券选择策略

本基金将优先考虑安全因素,选择交易、到期回等高等级或高等级的债券品种进行投资以规避风险。在基金投资的过程中,本基金将首先将各种品种的信用等级、剩余期限和流动性(日均成交量和平均每日成交金额)进行初步筛选,然后选择各券种的收益率与剩余期限的结构进行匹配,评估其投资价值,进行再次筛选,最后,根据各券种的到期收益率波动性与再投资(流量量、日均成交量与再投资成本)决定具体投资品种。
3、久期策略
本基金根据对未来短期利率走势的研判,结合货币市场基金资产的高流动性要求及其相关的投资比例限制,动态调整组合的久期。当预期市场利率将上升时,本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期,以降低组合跌价风险;当预期市场利率将下降时,则通过增持剩余期限较长的债券等方式提高组合久期,以分享债券价格上涨的收益。
4、回购策略
根据回购市场利率走势变化情况,在回购利率较低时,本基金在严格遵守相关法律法规的前提下,利用正回购操作循环融入资金进行债券投资,提高基金收益水平。
另一方面,本基金将根据资金供求的季节效应,积极捕捉收益率峰值的短期机会,如新发行期间、年末资金回笼时点的季末效应等短期资金供求失衡,导致回购利率突增等。此时,本基金可通过逆回购的方式融入资金以分享短期资金拆利率提升的投资机会。
5、套利策略
本基金针对不同类型交易品种受市场、交易模式、环境冲击、流动性等因素影响出现定价差异,从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上,适度进行跨市场或跨品种套利操作,提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利,期收益或品种结构的不同而形成的互换操作(跨期限套利)。
6、现金流管理策略
本基金作为现金管理工具,具有较高的流动性要求,本基金将根据对市场资金面分析,及时调整资产组合,通过回购操作流动性和债券品种的期限结构,动态调整并有效分配基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。
(二)投资决策流程
1、决策依据
(1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;
(2)以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则;
(3)参考宏观经济形势、宏观经济政策、宏观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球投资趋势。
2、投资管理程序
(1)投资组合的形成与维护
对于债券投资,分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断,采用利率模型、信用风险模型及期权调整价差(OAS)对普通债券和含权债券进行分析,在此基础上形成基金债券投资备选库。
(2)天津万家财富资产管理有限公司
本基金管理人定期召开投资决策会议,讨论基金的资产配置组合以及个券配置,形成资产配置建议。
(3)构建投资组合
投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下,审议并确定基金资产配置方案,并审批重大单项投资决定。
基金经理在投资决策委员会的授权下,根据本基金的投资资产配置要求,参考资产配置会议讨论结果,制定具体的投资策略,在其权限范围内,进行基金的日常投资组合管理工作。
(4)交易执行
基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室根据投资指令具体执行交易操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。
(5)投资组合监控与调整
本基金管理人风险控制委员会下设基金投资风控执行情况,风险管理部与监察稽核部对基金投资组合进行实时监控,风险管理分析师负责完成内部的基金业绩风险评估,基金经理定期对证券市场行情和基金投资组合成果和经验进行总结评估,对基金投资组合不断进行调仓优化。
十、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:同期7天通知存款利率(税后)
通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款品种,存取方便,利率高于活期存款。
本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征,根据基金的投资目标、投资目标及流动性特征,本基金选取同期7天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。
如果今后法律法规发生变化,或者有其他更具代表性、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。
本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
十二、基金投资组合报告
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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月12日对本基金投资组合报告,净值和业绩投资组合等内容,进行了复核并保证其不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告组合报告所载数据截至2019年03月31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
金额单位:人民币元
序号 项目 金额 占基金总资产比例(%)
1 固定收益投资 3,098,156,433.88 97.36
其中:债券 3,098,156,433.88 97.36
资产支持证券 -- --
2 买入返售金融资产 4,038,433,977.68 124.43
其中:买断式回购买入返售金融资产 -- --
3 银行存款和拆入资金合计 2,505,070,502.41 77.44
其中:活期存款 38,470,198.14 1.19
4 合计 10,568,130,943.99 100.00
2、报告期末债券投资组合情况
金额单位:人民币元
序号 项目 金额 占基金资产净值比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 10,111
其中:买断式回购融资 -- --
2 序号 项目 金额 占基金资产净值比例(%)
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比例反映报告期内每个交易日报融资余额占基金资产净值比例的平均值,对于用于货币市场基金的资金(如银行间市场)可调整为交易日、月末。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
在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基金资产净值的20%。
3、基金投资组合平均剩余期限
3.1、基金投资组合平均剩余期限基本情况
项目 天数
报告期内投资组合平均剩余期限 107
报告期内投资组合平均剩余期限限制 63
注:投资组合平均剩余期限指交易日的组合平均剩余期限,若报告期末为非交易日,“报告期末投资组合平均剩余期限”项目则列示未交易日的数据。
报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限未发生过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
各报告期内基金资产净值中基金资产净值比例(%) 各报告期内基金资产净值中基金资产净值比例(%)
序号 平均剩余期限 基金资产净值中基金资产净值比例(%)
1 30天以内 39.81 3.49
2 30天(含)-60天 -- --
3 60天(含)-90天 43.69 3.87
4 90天(含)-120天 7.36 --
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) 10.31 --
其中:剩余存续期限超过397天的浮动利率债券 -- --
合计 103.17 3.49
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发生过240天的情况。
5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元
序号 债券品种 摊余成本 占基金资产净值比例(%)
1 国债逆回购 463,082,964.46 4.56
2 央行票据 -- --
3 金融债券 99,999,562.78 0.99
其中:政策性金融债 0.00 0.00
4 企业债券 200,012,419.96 1.97
其中:中期票据 790,511,948.99 7.29
5 资产支持证券 190,945,262.77 1.87
6 银行存款 2,181,600,462.13 21.50
7 其他 -- --
8 合计 3,026,156,433.88 30.69
9 剩余存续期限超过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
金额单位:人民币元
序号 债券代码 债券名称 债券数量(元) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)
1 11181285 招 普 安 银 行 C2395 4,000,000 397,096,160.11 3.91
2 1118182222 18 中 信 银 行 C9222 3,000,000 297,096,842.36 2.91
3 111807181 招 普 商 行 行 C93181 2,000,000 198,582,167.46 1.96
4 111818243 18 民 生 银 行 C9364 2,000,000 198,393,934.40 1.96
5 111812897 招 普 安 银 行 C9297 2,000,000 198,016,570.25 1.96
6 1909911 19安融银行 1,000,000 100,000,000.00 1.00
7 111812187 18 北 京 银 行 C93167 1,900,000 181,711,426.06 1.81
8 111801160 招 普 安 银 行 C93160 1,500,000 158,836,462.04 1.57
9 139456 16招商16 1,500,000 150,000,000.00 1.48
10 190908 19安融银行 1,200,000 119,566,794.42 1.19
7、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值偏离度
项目 偏离度
报告期内偏离度的绝对值 0.0091%
报告期内偏离度的最高值 0.0094%
报告期内偏离度的最低值 0.0089%
报告期内偏离度绝对值前5大的期间 0.0094%
报告期内偏离度绝对值前5大的资产 0.0094%
报告期内偏离度绝对值前5大的机构 -- --
注:报告期内偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本报告期间,本货币市场基金投资组合未发生偏离度的绝对值达到0.25%的情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本报告期间,本货币市场基金投资组合未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
9.1、基金计价方法说明
本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在持有期间内按实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金资产净值的方式,对基金资产净值进行估值。
上述“一”基金费用的构成中第三项“管理费”,根据有关法规及协议约定,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)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失;
2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3.《基金合同》生效前的相关费用;
4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(四)基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。
十、基金收益
本基金运作过程中涉及的各项税费,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
十五、对招募说明书部分的说明
本基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》(货币市场基金监督管理办法)、《关于实施<货币市场基金监督管理办法>有关问题的规定》、《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的规定,对本基金管理人编制的《天弘现金管家货币市场基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:
1.更新了“重要提示”中相关内容;
2.更新了“四、基金托管人”中相关内容;
3.更新了“五、基金份额持有人”中相关内容;
4.更新了“十二、基金投资组合报告”中相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经过审计;
5.更新了“十二、基金的业绩”的相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经过审计。
天弘基金管理有限公司
二〇一九年八月一日

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	固定收益投资	3,098,156,433.88	97.36
2	买入返售金融资产	4,038,433,977.68	124.43
3	银行存款和拆入资金合计	2,505,070,502.41	77.44
4	合计	10,568,130,943.99	100.00

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	10,111	
2	其中:买断式回购融资	--	--
3	其中:政策性金融债	0.00	0.00
4	其中:中期票据	790,511,948.99	7.29
5	其中:资产支持证券	190,945,262.77	1.87
6	其中:银行存款</		