

信息披露

Disclosure

(上海B054版)

注册地:泉州市云鹿路3号
 地址:泉州市鲤城区南环路3号
 法定代表人:傅子健
 客户服务电话:400-889-6312
 网址: www.gzcbank.com/

(120) 一路财富(北京)信息科技有限公司
 (120) 北京西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
 法定代表人:吴雪涛
 客服电话:4000115666
 网址: www.yiufucai.com

(121) 北京恒天明泽基金销售有限公司
 地址:北京市朝阳区东三环中康中心A座23层
 法定代表人:梁斌
 客服电话:400890618
 网址: www.chtfund.com/

(122) 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16楼B单元
 法定代表人:刘惠
 客户服务电话:400-808-1016
 网址: http://www.fundshiny.com

(123) 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:胡学勤
 客服电话:400-866-6618
 网址: www.lufund.com

(124) 盈米基金销售有限公司
 (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:上海市长宁区福北路518号8号楼3层
 法定代表人:姚斌
 客户服务电话:400-466-6788
 网址: www.66zichan.com

(125) 深圳前海微众银行股份有限公司
 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七道惠康大厦二期418室
 法定代表人:齐小贺
 客户服务电话:0755-83999913
 网址: www.mingxinw.com

(126) 北京汇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16层1603
 法定代表人:董浩
 客户服务电话:400-068-1176
 网址: www.jiandianfund.com

(127) 珠海盈米基金销售有限公司
 办公地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
 注册地址:广州市南沙区新区大道1号1号保利国际广场南塔12楼
 法定代表人:肖雯
 客户服务电话:020-89629066
 网址: www.yingmi.com

(128) 宏信证券有限责任公司
 注册地址:四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
 办公地址:四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
 法定代表人:王志刚
 客服电话:4008-366-366
 网址: http://www.hxqz.com

(129) 上海利得基金销售有限公司
 注册地址:上海市宝山区川沙路5475号1033室
 办公地址:上海市虹口区东大名路1088号金融世纪广场
 法定代表人:李兴军
 客服电话:4000676266
 网址: www.laobank.com.cn

(130) 北京君德汇富基金销售有限公司
 注册地址:北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
 办公地址:北京市东城区朝阳门内大街8号富华大厦F座12层B室
 法定代表人:李昱
 客户服务电话:400-066-9355
 网址: www.kstresure.com

(132) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
 地址:北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心5层
 法定代表人:彭运华
 客户服务电话:4008909998
 网址: www.jnw.com

(133) 泰信财富投资管理有限公司
 地址:北京市石景山区实兴大街30号院3号楼3层B995995
 法定代表人:李静
 客户服务电话:400-168-7575
 网址: www.taixinfund.com

(134) 上海智汇基金销售有限公司
 地址:上海市黄浦区西藏南路765号402-115室
 法定代表人:陈继武
 客户服务电话:4000 178 000
 网址: www.lingxianfund.com

(135) 上海中正达广基金销售有限公司
 地址:上海市徐汇区龙腾大道2015号302室
 法定代表人:黄欣
 客户服务电话:400-6767-523
 网址: www.zzwelth.cn

(136) 苏州银行股份有限公司
 注册地址:江苏省苏州市工业园区钟园路728号
 办公地址:江苏省苏州市工业园区钟园路728号
 法定代表人:王凤
 客服电话:96067
 网址: www.suzhoubank.com

(137) 扬州国信嘉利创新销售有限公司
 注册地址:广陵区产业园创业路7号
 办公地址:扬州市江都区文昌西路56号公园国际大厦3层
 法定代表人:沈洁明
 客户服务电话:400-021-6088
 网址: www.gxlj.com

(138) 北京格上富信投资顾问有限公司
 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
 客户服务电话:010-82350618
 公司网址: www.igesafund.com

(139) 北京国和基金销售有限公司
 注册地址:北京市西城区车公坟大街4号5号楼1层
 办公地址:北京市西城区车公坟大街4号5号楼1层
 法定代表人:徐福瑞
 客户服务电话:400-819-0030
 公司网址: www.bzfunds.com

(140) 东莞农村商业银行股份有限公司
 注册地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号
 办公地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号
 法定代表人:何润良
 客户服务电话:0769-9611222
 网址: www.drcbank.com

(141) 北京银泰天下投资管理有限公司
 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:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层
 法定代表人:蒋辉
 客户服务电话:4008188866
 公司网址: www.shegshiview.com

(142) 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路海岸大厦1115室,1116室及1307室
 法定代表人:TAN YIK KUAN
 联系人:叶婵
 客户服务电话:400-684-0500
 公司网址: www.ifastps.com.cn

(143) 北京广源达信基金销售有限公司
 注册地址:北京市西城区新街口外大街28号中盛大厦605室
 办公地址:北京市朝阳区望京东园四区中项中心D座19层
 法定代表人:李昊
 客户服务电话:4006228600
 公司网址: www.niunifund.com

(144) 中泰证券股份有限公司
 注册地址:山东省济南市经七路86号
 办公地址:山东省济南市经七路86号
 法定代表人:李海
 客户服务电话:95538
 网址: http://www.zts.com.cn

(145) 申万宏源西部证券有限公司
 注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦2005室
 办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦2005室
 法定代表人:韩志健
 客户服务电话:4008000652
 公司网址: www.swwhy.com

(146) 中信期货有限公司
 注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室
 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室
 法定代表人:张皓
 客户服务电话:400-990-8826
 网址: www.citicf.com

(147) 深圳市弘亚基金销售有限公司
 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层
 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层
 法定代表人:赖任军
 客户服务电话:400-930-0660
 公司网址: www.jfzinv.com

(148) 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(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
 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:高峰
 客户服务电话:400-804-8888
 公司网址: www.keynesasset.com

(149) 江苏常裕农村商业银行股份有限公司
 注册地址:江苏省常熟市新城市大道55号
 法定代表人:宋建明
 客户服务电话:400962000 0612-962000或前往常熟农商银行各营业网点进行咨询
 网址: www.csrcbank.com

(150) 北京康银基金销售有限公司
 注册地址:北京市西城区德胜大街1号院2号楼2单元21层222507
 办公地址:北京市朝阳区创远路3号院融科资讯中心C座17层,邮编:100102
 法定代表人:孙奕斐
 客户服务电话:400618818
 网址: https://www.kysec.com.cn

(151) 上海聚基基金销售有限公司
 注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
 办公地址:上海市浦东新区昆明路518号北美广场A1002-1003室
 法定代表人:王翔
 客户服务电话:400-820-5369

(152) 北京创盈富源投资管理有限公司
 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A
 法定代表人:梁睿
 客户服务电话:400-6262-818
 公司网址: www.51rich.com

(153) 北京京爱基金销售有限公司
 注册地址:北京市西城区中关村大街11号11层1108
 办公地址:北京市西城区中关村大街11号11层1108
 法定代表人:王伟刚

400-619-9069

公司网址: www.fundzone.cn
 (154) 江苏国农农村商业银行股份有限公司
 注册地址:江苏省昆山市前进东路828号
 办公地址:江苏省昆山市前进东路828号
 法定代表人:张晋青
 客户服务电话:0612-96079
 公司网址: www.jsrccb.com

(155) 北京新浪乐信基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区北四环西路68号906室
 办公地址:北京市海淀区海淀北二街10号泰康大厦12层
 法定代表人:张帆
 客户服务电话:010-62675369
 公司网址: www.xincail.com

(156) 嘉兴银行股份有限公司
 注册地址:嘉兴市建国南路409号
 办公地址:嘉兴市建国南路409号
 法定代表人:夏林生
 客户服务电话:0573-96528
 公司网址: www.boj.com.cn

(157) 宁波银行股份有限公司
 注册地址:宁波市鄞州区宁南路700号
 办公地址:宁波市鄞州区宁南路700号
 法定代表人:陆华裕
 客户服务电话:96574
 公司网址: www.nbc.com.cn

(158) 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:王岩磊
 联系电话:025-53271185
 传真号码:025-5071 0161
 (161) 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:北京市朝阳区霞光路26号鹏润大厦B座19层
 法定代表人:王岩
 客服电话:400-029-7174
 公司网址: www.gomefund.com

(162) 南京途牛金融信息服务有限公司(仅代销:华安现金富利A040003)
 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:杨瑞
 客服电话:40077-999-99
 网址: http://jr.tuniu.com

(163) 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南路康宁街互联网金融大厦6层
 办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
 法定代表人:李慧斌
 客服电话:400-885-671
 网址: www.hgcbp.com

(164) 上海云湾基金销售有限公司
 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:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
 法定代表人:戴新
 联系电话:021-20638988
 传真号码:021-20638999
 (165) 乾道金融信息服务有限公司(北京)有限公司
 注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层1717室
 办公地址:北京市海淀区德外大街合生财富广场1302室
 法定代表人:王兴吉
 联系电话:010-62062980
 传真号码:010-62062741
 (166) 北京博路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惠通河畔产业园区1111号
 法定代表人:许国民
 客服电话:4001-50-092
 网址: www.lamao.com

(167) 华鑫证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01层16A
 (b) 单元
 法定代表人:俞洋
 客服电话:021-32109999
 网址: http://www.cfsc.com.cn

(168) 东海期货有限责任公司
 注册地址:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
 办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
 法定代表人:王洪
 电话:0561400-8989588
 网址: www.qh168.com

(169) 湖北银行股份有限公司
 注册地址:石家庄市平安大街28号
 办公地址:石家庄市平安大街28号
 法定代表人:李志强
 客户服务电话:400-612-9999
 公司网站: www.hbcbank.com

(170) 济安财富(北京)基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心A座46层
 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心A座46层 济安财富
 法定代表人:杨健
 客户服务电话:400-075-6663(东方财富官网) 400-071-6766(腾訊财经)

公司网站: www.jianfortune.com
 (171) 泰诚财富基金销售有限公司(大)有限公司
 法定代表人:林翠
 地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
 办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
 电话:400-6411-990
 网址: www.taichengcaifu.com

(172) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司
 注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
 注册资本:2000万元
 法定代表人:江涛
 客服电话:400-891-0888
 公司网站: http://fund.jd.com/

(173) 福建海峡银行股份有限公司
 注册地址:福州市台江区江滨中大道358号福建海峡银行
 办公地址:福州市台江区江滨中大道358号福建海峡银行
 法定代表人:南泉
 客户服务电话:24-803-9999
 公司网站: www.fhxbank.com

(174) 上海华瀚汇德基金销售有限公司
 注册地址:上海市浦东新区上丰路977号1幢B座212室
 办公地址:上海浦东碧波路904号7号楼2层
 法定代表人:廖冰
 联系电话:021-31289666
 传真:(021) 31289600
 (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)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦501室01单元
 办公地址:上海市湖滨大道20号展业广场2座普华永道中心11楼执行事务合伙人:李静
 联系电话:(021) 23238888
 传真:(021) 23238800
 联系人:张博
 经办注册会计师:单峰、魏佳亮

九、基金的投资目标
 本基金的投资目标是:在资本保全的前提下,追求基金资产的长期增值,力争实现基金资产的增值,并为投资者提供持续的流动性储备。

十、基金的投资方向
 本基金为契约型开放式投资基金,提供投资者于短期资本市场获取投资收益的渠道。
 本基金主要投资于价格波动幅度及信用风险低并具有高度流动性的短期金融工具,如现金、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、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、中国证监会允许投资的资产支持证券,以及法律法规或中国证监会允许中国境内发行的其他具有良好流动性的金融工具。
 本基金不得投资于下列资产:
 (一) 投资范围
 基金管理人将充分发挥自身的研发力量,利用公司研究开发的各种数量模型工具,采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,发现并捕捉短期资本市场机会,实现基金的投资目标。
 (二) 资产配置策略
 本基金采取定期调仓方式为投资对象,而定期金融工具本身是风险低的投资品种,资本不能保全的风险非小,因此资产配置的重点在于投资于流动性及收益低两个方向。
 据此,本基金在实际操作中主要依据短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境,建立动态定期策略,通过判断确定不同资产配置比例和同类资产的基于不同利率期限结构的流动性比例。
 2.除此之外,还可能使用以下资产配置策略:
 (1) 市场套利策略:根据各细分市场流动性及收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场间的配置比例。比如,当交易所市场配置比例高于银行间市场配置比例时,可通过增加交易所市场的配置比例,或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。
 (2) 跨品种套利策略:即根据各细分市场不同品种的流动性及收益特征,动态调整不同利率期限结构的品种配置比例。比如,长期回购利率低于长期回购利率时,在既定变现需求下,可通过增长长期回购利率配置于短期回购利率、长期债券等实现跨品种套利。

(186)深圳市锦安基金销售有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号前海深港合作区管理综合办公中心A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
 办公地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号前海深港合作区管理综合办公中心A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
 法定代表人:李学东
 联系电话:400-600-9898
 网址: http://www.jiananfund.com/

(187) 江苏汇林保大基金销售有限公司
 (注册地址:南京市雨花台区软件大道199号)
 住所:常州市和平中路413号
 法定代表人:陆向阳
 联系电话:(0519) 96005
 网址: http://www.jhlbd.com/index.html

(188) 万家财富基金销售有限公司
 住所:天津自贸区(中心商务区)滨重大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
 法定代表人:李修存
 联系电话:13901314076
 客户服务电话:010-59013825
 网址: http://www.wanjiawealth.com/

(189) 宜信普信(北京)基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809
 法定代表人:戎兵
 网址: http://www.yixinfund.com/

客服电话:400-6109-200
 (190) 深圳前海微众银行股份有限公司
 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
 法定代表人:田文
 客服电话:400-666-0066
 网址: www.xcfunds.com

(191) 嘉御财富基金销售有限公司
 住所:深圳市福田区香梅路1005153室
 法定代表人:陈健
 客服电话:0891-6177483
 网址: http://www.xjqcfund.com/cctv/home/aboutUs

(192) 泛华普益基金销售有限公司
 注册地址:成都市成华区建设路2号高地中心1101室
 法定代表人:李博
 客服电话:400-885-6618
 网址: http://www.e618.com/

(196) 华林证券股份有限公司
 注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋三层3号
 办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
 法定代表人:林立
 客户服务电话:400-188-3888
 公司网站: http://www.chinalions.com/

(197) 深圳前海微众银行股份有限公司
 注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)深圳市南山区桃园路1819号微众国际中心A36楼
 办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
 法定代表人:顾敏
 客服电话:4009998777
 网址: www.webank.com

(198) 西藏东方财富证券股份有限公司
 注册地址:拉萨市北京中路101号
 办公地址:拉萨市北京中路101号
 法定代表人:陈宏
 客户服务电话:021-54599099
 公司网站: www.eastmoney.com

(199) 大同财富基金销售有限公司
 法定代表人:王珏
 住所:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1-01室
 网址: http://www.urainf.com/

联系电话:0851-88235678
 (200) 北京电盈基金销售有限公司
 法定代表人:程刚
 住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)常业楼36层3603室
 电话:400-100-2588
 网址: http://www.dianyingfund.com/

(201) 上海有鱼基金销售有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道2123号2层3F-2655室
 法定代表人:林卓
 客服电话:021-60907378
 (202) 北京信泰基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外大街2号北京信泰1504室1505室
 法定代表人:张冠宇
 客服电话:400-819-9688
 网址: http://www.tcfh.com.cn/

办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
 地址:北京市东城区广益南里8号院2号楼106室-67
 法定代表人:于龙
 网站地址: www.zhixin-inc.com

(206) 元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:马永涛
 联系电话:021-69701053
 联系人:李煜
 名称: 华安基金与过户登记人
 名称: 华安基金与过户登记人
 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号中国中心二期31-32层
 法定代表人:朱学华
 电话:(021) 38999999
 传真:(021) 33627962
 联系人:赵晨
 客户服务电话:40088-50099

(三) 律师事务所和经办律师
 名称: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
 联系人:韩炯
 电话:(021) 31258666
 传真:(021) 31258600
 经办律师:韩炯、秦悦民
 (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)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦501室01单元
 办公地址:上海市湖滨大道20号展业广场2座普华永道中心11楼执行事务合伙人:李静
 联系电话:(021) 23238888
 传真:(021) 23238800
 联系人:张博
 经办注册会计师:单峰、魏佳亮

十一、基金的投资策略
 本基金为契约型开放式投资基金,提供投资者于短期资本市场获取投资收益的渠道。
 本基金主要投资于价格波动幅度及信用风险低并具有高度流动性的短期金融工具,如现金、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、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、中国证监会允许投资的资产支持证券,以及法律法规或中国证监会允许中国境内发行的其他具有良好流动性的金融工具。
 本基金不得投资于下列资产:
 (一) 投资范围
 基金管理人将充分发挥自身的研发力量,利用公司研究开发的各种数量模型工具,采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,发现并捕捉短期资本市场机会,实现基金的投资目标。
 (二) 资产配置策略
 本基金采取定期调仓方式为投资对象,而定期金融工具本身是风险低的投资品种,资本不能保全的风险非小,因此资产配置的重点在于投资于流动性及收益低两个方向。
 据此,本基金在实际操作中主要依据短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境,建立动态定期策略,通过判断确定不同资产配置比例和同类资产的基于不同利率期限结构的流动性比例。
 2.除此之外,还可能使用以下资产配置策略:
 (1) 市场套利策略:根据各细分市场流动性及收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场间的配置比例。比如,当交易所市场配置比例高于银行间市场配置比例时,可通过增加交易所市场的配置比例,或在银行间市场融资、交易所市场融券而实现跨市场套利。
 (2) 跨品种套利策略:即根据各细分市场不同品种的流动性及收益特征,动态调整不同利率期限结构的品种配置比例。比如,长期回购利率低于长期回购利率时,在既定变现需求下,可通过增长长期回购利率配置于短期回购利率、长期债券等实现跨品种套利。

滚动配置策略:根据具体投资品种的市场特性,采用持续投资的方法

以提高基金资产的整体变现能力。例如,对中长期回购协议可每天进行等量配置,而短期配置在回购协议上基金资产流动性。
 利率调整策略:在深入分析财政、货币政策以及短期资金市场,资本市场资金面的情况和流动性的基础上,对利率走势形成合理预期,并据此调整基金资产配置策略。比如,根据历史上一我国短期金市场利率的走势,在年初、年末资金利率较高时增持短期配置基金资产,而在年中资金利率偏低时则减持短期配置基金资产。
 (二) 投资管理的基本程序
 1. 投资决策
 投资决策委员会定期召开会议,对阶段性的投资组合整体风险水平和资产配置比例做出决议。
 2. 研究支持
 研究发展部对债券或票据的信用评级和差别定价,对宏观经济主要是利率走势等进行分析,主要提出个券选择方面的建议;金融工程小组利用动态规划模型和风险控制模型对投资组合的收益、风险等进行分析,提出组合配置、调整和风险控制的方面的建议;基金注册部提供申购、赎回的动态情况,供基金经理参考。
 3. 构建组合
 基金经理根据投资决策委员会决议,研究发展部及金融工程小组的研究成果,以及申购、赎回的动态情况,在综合判断的基础上,在授权范围内设计和调整投资组合。
 4. 交易执行
 基金经理利用华安投资交易系统和华安固定收益管理系统向集中交易部下达交易指令。
 5. 归因分析
 金融工程小组利用公司开发的归因分析系统对投资组合中类属配置、期限配置、品种选择、买卖成本等因素对整体业绩的贡献进行归因分析。该归因分析系统将为基金经理进行积极配置风险控制和调整提供依据。
 6. 监控稽核
 稽核部对投资组合的合规性和合理性及执行情况进行稽查并将稽查报告提交给相关负责人。
 (三) 投资操作程序
 1. 决策流程
 投资决策委员会将最终决策下达至基金经理,由基金经理根据投资决策委员会的决议,根据投资决策委员会的决议,基金经理须研究投资发展部及金融工程小组开展进一步策划,对单个投资品种及仓位、期限构成和数量等进行进一步的细化,提出完整的操作策略。
 2. 交易过程
 基金经理将投资指令下达给集中交易部,由交易员组织实施具体操作,操作过程中交易员须提出完成组合投资的时间安排和价格控制目标,并开展交易。
 3. 评估过程
 基金运作进行评估,主要包括两方面的内容,一是对投资组合构建执行情况的评估,主要是评估交易完成程度、交易价格目标的实现情况,构建过程中市场流动性等变化对基金建仓成本的影响等;二是组合投资构建后对整个组合收益、收益等的综合评价。
 (四) 分析与调整
 基金经理在归因分析报告的基础上,根据宏观经济、市场走势等因素动态调整对投资组合进行跟踪,并根据调整要求对集中交易部下达投资指令,集中交易部完成投资指令,实现投资组合的调整。
 (四) 基金融资
 本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。
 十二、基金业绩比较基准
 以当期银行一年期活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。
 十三、基金的风险收益特征
 本基金面临与其他开放式基金不同的风险(如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但由于本基金是以短期金融工具投资为主的低风险开放式基金,上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要投资于短期金融工具,经济周期风险、利率风险、信用风险、再投资风险、新产品创新带来的风险、流动性风险、现金管理风险、技术风险、管理风险、巨额赎回风险等。
 十四、基金的投资组合报告
 基金管理人及董事会对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。
 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15日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、误导性陈述或者重大遗漏。
 本投资组合报告所载数据截至2019年6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	1,628,096,376.28	33.88
	其中:债券	1,628,096,376.28	33.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,501,739,432.61	31.10
	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	1,084,549,806.18	22.89
4	其他资产	16,126,743.70	0.34
5	合计	4,829,370,357.77	100.00

2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	315	-
	其中:买断式回购融资	-	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	619,869,202.06	14.67
	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与报告期末每个交易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
 无。
 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	31
报告期内投资组合平均剩余期限	46
报告期内投资组合平均剩余期限	36

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
 无。
 报告期内本基金资产组合平均剩余期限未超过120天。
 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(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	69.67	14.67
2	其中:剩余存续期超过307天的浮动利率债	-	-
3	30天含-180天	27.38	-
4	其中:剩余存续期超过307天的浮动利率债	-	-
5	60天含-180天	12.83	-
6	其中:剩余存续期超过307天的浮动利率债	-	-
7	90天含-120天	-	-
8	其中:剩余存续期超过307天的浮动利率债	-	-
9	120天含-180天	4.76	-
10	其中:剩余存续期超过307天的浮动利率债	-	-
合计	1,628,096,376.28	33.74	14.67

4 报告期末投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
 无。
 5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	债券规模(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160916	16附息国债16	2,200,000	220,014,039.33	5.24
2	11190181	19国债18	2,000,000	199,627,617.47	4.76
3	11191028	19国债24	2,000,000	198,611,242.19	4.73
4	11191024	19国债18	2,000,000	197,981,163.80	4.71
5	11190913	19国债08	2,000,000	197,887,379.90	4.70
6	11180625	18国债07	1,000,000	99,871,299.53	2.38
7	11190905	19国债06	1,000,000	99,719,923.54	2.37
8	11191075	19国债07	1,000,000	99,529,461.63	2.37
9	11190975	19国债07	1,000,000	99,406,968.71	2.37
10	11190703	19国债10	700,000	69,770,178.46	1.66

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	偏离度的绝对值占基金资产净值的比例
报告期内偏离度的绝对值占基金资产净值的比例	0.0%
报告期内偏离度的最高值	0.0311%
报告期内偏离度的最低值	-0.0102%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均值	0.0082%