

（上接B059版）

(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1002室
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:王莉
电话:010-85650628
联系人:刘洋
客服电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
(58) 名称:浦银基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区望京园四区13号楼A座9层908室
办公地址:北京市朝阳区望京浦银中心A座9层04-08
法定代表人:李招弟
电话:010-59497361
联系人:李楠
客服电话:400-876-9988
网址:www.zsfund.com
(59) 名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层
法定代表人:张跃伟
电话:021-20691832
联系人:胡雪芹
客服电话:400-820-2899
网址:www.chinawealth.com
(60) 名称:北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建城大厦12层1208号
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建城大厦12层1208号
法定代表人:罗爱华
电话:010-67000988
联系人:李浩
客服电话:400-001-8811
网址:www.zcfund.com
(61) 名称:上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475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:郭丹妮
客服电话:400-921-7755
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号同花顺大楼
法定代表人:吴强
电话:010-577-3772
客服电话:400-892-6995
网址:www.10jqka.com.cn
(63) 名称:北京微众基金销售有限公司
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:赵荣春
电话:010-57418813
联系人:李超
客服电话:400-893-6995
网址:www.wanjiang.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:蒋雪琦
电话:0671-88337717
联系人:孙成岩
客服电话:400-068-0068
网址:www.jincheng-fund.com
(65) 名称:安徽基金销售有限公司
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:刘煜
电话:021-80133828
联系人:徐琳琳
客服电话:400-808-1016
网址:www.tundaiyuan.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民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人:马勇
电话:010-83263101
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn
(67) 名称:上海陆金所基金销售有限公司
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:王之宏
电话:021-20665952
联系人:宁博宇
客服电话:400-821-9031
网址:www.lufunds.com
(68) 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:郑婉敏
电话:010-86643600
联系人:姜颖
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
(69) 名称:上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
电话:021-52822063
联系人:兰敏
客服电话:400-166-6788
网址:www.66zichan.com
(70) 名称:大泰基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506号东方汇大厦15层
法定代表人:袁振钢
电话:021-22267943
联系人:朱真卿
客服电话:400-928-2266
网址:www.dttunds.com
(71) 名称:一路财富(北京)信息科技有限公司
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:吴勇秀
电话:010-88312577
联系人:徐越
客服电话:400-001-1566
网址: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:020-89629099
联系人:邱湘湘
客服电话:020-89629096
网址:www.yingmi.com.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
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:0755-89460507,0755-89460500
联系人:叶健
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifunds.com
(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慧广场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:赖建强
电话:0755-84034499
联系人:张烨
客服电话:400-9302-888
网址:www.jfzinv.com
(75) 名称:武汉市伯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:陆捷
电话:027-83863742
联系人:陆捷
客服电话:400-027-9899
网址:www.buyifunds.cn
(76) 名称:上海万得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区临海路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:021-50717262
联系人:袁伟156710161
客服电话:400-021-0203
网址:www.520fund.com.cn
(77) 名称:深圳众济基金销售有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科苑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:0755-8399907-819
联系人:刘勇
客服电话:0755-8399907
网址:www.zhongji.com.cn
(78) 名称:北京微众基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼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:010-52609656
联系人:季长军
客服电话:400-188-5687
网址:www.buyforyou.com.cn
(79) 名称:北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环(3F)4D-11号3636303室
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B座
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.dianyingfund.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11层1108室
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人:王树刚
电话:010-62969527
联系人:丁尚帅
客服电话:400-619-9069

网址:www.hcjin.com
(81) 名称:北京晟视天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21B及28层
法定代表人:王莉
电话:400-818-8866
联系人:徐晓亮,刘聪慧
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(上海泰和经济发达区)
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:王翔
电话:021-65370077
联系人:吴鸿飞
客服电话:400-820-5389
网址:www.jiayufund.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:李修普
电话:010-59013825
联系人:王芳芳
客服电话:010-59013942
网址:www.wanjiawealth.com
(84) 名称:杭州伟恒财富基金销售有限公司
住所:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
电话:0571-85267500
联系人:胡璇
客服电话:0571-86655020
网址:www.ct121.com
(85) 名称:上海琪石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安路91号新弘大厦4楼
法定代表人:陈海武
电话:021-63333389
联系人:王哲宇
客服电话:400-643-3389
网址:www.vstonewealth.com
(86) 名称:深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE
法定代表人:高峰
电话:0755-82880158
联系人:廖嘉琦
客服电话:400-804-8988
网址:www.keynesasset.com
(87) 名称:贵州华阳众基基金销售有限公司
住所:贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房
办公地址:贵州省贵阳市云岩区北京路9号君豪大厦16楼
法定代表人:程雷
电话:0851-86909560
联系人:陈璇
客服电话:400-838-1818
网址:www.hyzfund.com.cn
(88) 名称:北京壹基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61840888
联系人:戚晓强
客服电话:4000618818
网址:danjuanapp.com
(89) 名称:北京恒信基金销售有限公司
住所:北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区西四环北路105号10号楼
法定代表人:于戈
电话:187-0135-8825
联系人:吴鹏
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-ivn.com
(90) 名称:上海有鱼基金销售有限公司
住所:上海自由贸易试验区浦东大道1223号3层3E-2655室
办公地址:上海市徐汇区桂平路391号B座19层
法定代表人:林洪
电话:021-49007979
联系人:黄志雄
客服电话:021-60907978
网址:www.youyufund.com
(91) 名称:上海财财基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼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楼01.02.03室
法定代表人:胡晓亮
电话:010-62880827
联系人:樊明晴
客服电话:021-50810673
网址:www.wacaijin.com
(92) 名称:南京苏宁基金销售有限公司住所:南京市玄武区苏宁大道1号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1号
法定代表人:孙成文
电话:025-66996699-887226
联系人:王臻
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com
(93) 名称:济安财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区大屯路甲10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:杨屹
电话:010-66309516
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
(94) 名称:上海中正达广基金销售有限公司
住所: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
法定代表人:周敏
电话:021-3376-8132
联系人:戴晨薇
客服电话:021-3376-8132
网址:www.zhongzhengfund.com
(95) 名称:凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼10000号
办公地址:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402-75000号
法定代表人:张旭
电话:010-58160168
联系人:陈旭
客服电话:400-810-5919
网址:www.fengxit.com
(96) 名称:北京鼎鼎曜华投资咨询有限公司
住所:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号泰康金融中心38层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼38层03A座
法定代表人:张旭
电话:010-58160168
联系人:陈旭
客服电话:400-088-8816
网址:kenterui.jl.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)16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:孙雯
电话:021-50200003
联系人:杨一新
客服电话:021-50206003
网址:www.msftec.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2号泰康大厦B座8层
法定代表人:毛培华
电话:010-89060632
联系人:张帆明
客服电话:400-817-5666
网址:www.amcfund.com
(100) 名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区 飞鹿路360弄9号3724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:1561889508
联系人:余鹏飞
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:021-20219888-3528
联系人:宋楠
客服电话:021-20292031
网址:www.wg.com.cn
(102) 名称:北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市经济技术开发区北京大道10号五层1222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:周斌
电话:15249236571
联系人:陈璇
客服电话:400-898-0618
网址:www.chtfund.com
(103) 名称:通华财富(上海)基金销售有限公司
住所:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区金桥路55号通华科技大厦1层
法定代表人:王涛
电话:021-60819588
联系人:王筱伟
客服电话:051933956
网址:www.tonghuafund.com
(104) 名称:阳光人寿保险股份有限公司
住所:海南省三亚市迎龙路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦1层1
法定代表人:李科
电话:010-59053660
联系人:王超
客服电话:05610
网址:fundinsisig.com
(105) 名称:中信期货有限公司

住所: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、14层
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、14层
法定代表人:张皓
电话:021-60833754
联系人:刘宏慧
客服电话:400-990-8826
网址:www.ctiact.com
(106) 名称:兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:福建省福州市湖东路268号
法定代表人:杨华辉
电话:021-38565477
联系人:乔琳琳
客服电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn
(107) 名称:中汇金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室(100073)
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球世纪中心A座5层(100031)
法定代表人:钱昊昊
电话:010-56338544
联系人:沈晨
客服电话:400-890-8908
网址:www.jnlc.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:尹业明
联系人:黄娜娜
电话:021-38992887
(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:韩朝
联系人:黎明
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:吕红, 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:蔡建基
电话:021-53894966
传真:021-62818899
经办注册会计师:王丽霞, 陈彦君
五、基金的名称
国联安货币市场证券投资基金
六、基金的类型
货币市场基金
七、基金的投资目标
在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式管理,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)的银行存款、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,可以将其纳入投资范围。
九、基金的投资策略及程序
(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,把握收益率曲线形成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、市场供求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考察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收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在组合平均剩余期限整体调整的基础上,本基金将比较不同的投资策略,例如分子期限、杠铃策略和梯形策略等在不同市场环境下的表现,构建优化组合获取超额收益。
3. 资产配置策略
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)的市场规模、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和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效对组合的现金流,在保持本基金充分流动性的基础上争取超额收益。
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、银行套息和跨期限制利。
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择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。
同一市场择日正回购与逆回购之间的套利,指的是在任一市场第T天以低于金融同业存款利率的成本融入资金,而在T天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成本融入资金,同时在当天以高于金融同业存款利率的价格在同一种子融出资金,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同表现进行套利。比如当交易所市场回购利率高于银行市场回购利率时,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、交易所市场融券实现跨市场套利。
跨期限套利是指在货币市场基金投资平均期限的前提下,较短期限回购利率低于较长期限回购利率时,在既定的变现率水平下,可通过增加较长期限回购的配置比例,或进行较长期限融资、较长期限融券实现跨期限套利。
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的品种。通过分析各具体金融品种的剩余期限与收益率的匹配状况、信用等级状况、流动性指标等因素进行证券选择,选择风险收益配比最合理的品种作为投资对象。具体而言,个券选择遵循以下一些原则:
(1) 符合上述资产配置策略;
(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) 优先选择双边报价价格序列列表中的个券;
(6) 优先选择具有公开市场操作的个券。
(二) 投资决策流程
1. 投资决策流程
有关法律、法规、基金合同等的有关规定。
2. 投资管理程序
本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资策略;决定重大组合调整决策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 and 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) 研究部根据自身或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、投资建议支持。
(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) 执行投资操作及交易跟踪执行,并将与相关信息反馈基金经理。
(5) 风险管理部、数量管理部定期开展基金风险评估,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、基金的费用与税收
本基金业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)。
七天通知存款具有存期灵活、存取方便的特征,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,且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,本基金管理人可以依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,调整业绩比较基准无需经基金份额持有人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒介上刊登公告。
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,也低于混合型基金和股票型基金。
十二、基金的投资组合报告
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。
本基金的投资人——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、净值和投资组合报告等内容,保证复核结果不存在虚假记载、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日止,本报告财务资料未经审计师审计。
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	3,220,336,479.82	66.42
	其中:固定收益金融债	3,220,336,479.82	66.42
	资产支持证券	620,000.00	0.01
2	买入返售金融资产	2,032,032,634.63	31.82
	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	1,006,039,089.60	17.16
	其中:其他货币资金	38,400,992.79	0.69
5	合计	6,258,409,195.64	100.00

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券投资余额	95.53
	其中:固定收益金融债	-
2	报告期末债券回购融资余额	-
	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
在本报告期内货币市场基金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
3.1 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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

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	报告期基金资产净值比例(%)	各期限段基金资产净值比例(%)
1	30天以内	51.01	1.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天<1-60天	33.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天<1-90天	8.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天<1-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天<1-397天(含)	7.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
	合计	101.24	1.83

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,货币市场基金不存在投资组合平均剩余存续期超过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	-	-
2	央行票据	-	-
3	其中:政策性金融债	380,520,761.65	5.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	430,238,014.61	6.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,429,577,702.66	38.74
8	其他	-	-
9	合计	3,220,336,479.82	61.36
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法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	债券余额(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011901336	19国债02	2,000,000	199,835,330.88	3.19
2	111918140	19国债银行CD140	2,000,000	199,380,310.25	3.18
3	111813396	18国债银行CD136	2,000,000	199,173,389.53	3.18
4	111918161	19国债银行CD161	2,000,000	199,077,390.10	3.17
5	111803844	18国债银行CD144	1,500,000	189,613,216.91	3.02
6	190301	19国债01	1,500,000	149,946,630.15	2.39
7	111810562	18国债银行CD162	1,500,000	149,384,985.11	2.38
8	170402	17国债02	1,000,000	100,521,196.56	1.60
9	011900996	19国债01	1,000,000	100,045,655.00	1.60
10	111803854	18国债银行CD154	1,000,000	99,760,101.83	1.59

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%-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最大值	-0.03%
报告期内偏离度绝对值在0.5%-1%间的次数	-0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本报告期内货币市场基金不存在负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
本报告期内货币市场基金不存在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

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	1988013	19上银A1	1,000,000.000	620,000.00	6.01

9投资组合报告附注

9.1 基金投资买入“摊余成本法”,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

9.2 本报告期内,经查询上海证券交易所以、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台,本基金投资的前十名证券的发行主体中除民生银行外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

18国债银行CD136(111813396)的发行主体中国民生银行股份有限公司,因七项违法违规事项于2018年12月7日被中国银行保险监督管理委员会处以3160万元罚款。广州分行因违反支付结算管理规定被警告,于2019年1月23日被没收违法所得2,787,141.24元,并处罚款2,787,141.24元,合计罚没5,574,282.48元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策职责,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

9.3其他各项资产构成

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	17,682,260.99
4	应收申购款	20,538,631.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-