

（上接32版）

公司网址: www.danjuanapp.com  
(136) 名称: 方正证券股份有限公司  
注册地址: 湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701—3717  
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层  
法定代表人: 施华  
联系人: 胡剑  
客服电话: 96571  
网址: www.foundersc.com  
(136) 名称: 广州证券股份有限公司  
地址: 广州市天河区珠江西路6号广州国际金融中心主塔19层、20层  
法定代表人: 胡伏波  
联系人: 梁敬  
电话: 020-88836999  
客服电话: 96396  
网址: www.gzs.com.cn  
(137) 名称: 山西证券股份有限公司  
注册地址: 太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  
办公地址: 山西省太原市府西街69号国际贸易中心28层  
法定代表人: 侯巍  
联系人: 孟婉婷  
电话: 0351-8636602  
客服电话: 96573  
网址: www.i618.com.cn  
(138) 名称: 上海华信证券有限责任公司  
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼  
办公地址: 上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼  
法定代表人: 陈旭辉  
联系人: 徐豪  
电话: 021-63898427  
客服电话: 400—820—5999  
网址: www.shhxzq.com  
(139) 名称: 中国民族证券有限责任公司  
注册地址: 北京市朝阳区东直门内大街27号院5号楼  
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F—43F  
法定代表人: 何亚刚  
联系人: 李小雅  
电话: 010—59355930  
客服电话: 4008896618  
公司网址: www.e618.com  
(140) 名称: 中邮证券有限责任公司  
注册地址: 陕西省西安市唐延路6号(陕西西部信息大厦9—11层)  
办公地址: 北京市东城区珠市口东大街17号  
法定代表人: 丁奇文  
联系人: 邱帅  
电话: 010-67017788  
客服电话: 4008—8888—005  
网址: www.cnpsc.com.cn  
(141) 名称: 首创证券有限责任公司  
地址: 北京市西城区德胜门内大街115号德胜尚城B座  
法定代表人: 毕劲松  
联系人: 李淑敏  
电话: 010—59366077  
客服电话: 4006200620  
网址: www.sczq.com.cn  
(142) 名称: 太平洋证券股份有限公司  
地址: 云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼  
法定代表人: 李长伟  
联系人: 王娟  
电话: 010-88695182  
客服电话: 96397  
网址: www.tpyzq.com  
(143) 名称: 上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址: 上海市黄浦区中山东路12号  
办公地址: 上海市黄浦区中山东路12号  
法定代表人: 郑杨  
联系人: 姜楠彬  
电话: 021—61616885  
客服电话: 96528  
公司网址: www.spdb.com.cn  
(144) 名称: 平安银行股份有限公司  
注册地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路5047号  
办公地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路5047号  
法定代表人: 谢永林  
联系人: 陈海霞  
电话: 0755—22168301  
客服电话: 96511  
公司网址: www.bank.pingan.com  
(145) 名称: 宁波银行股份有限公司  
注册地址: 宁波市鄞州区宁东路345号  
办公地址: 宁波市鄞州区宁东路345号  
法定代表人: 陆华裕  
联系人: 廖晓英  
电话: 0574—89068258  
客服电话: 96574  
公司网址: www.nbcb.com.cn  
(146) 名称: 成都农村商业银行股份有限公司  
注册地址: 四川省成都市武侯区科华中路68号  
办公地址: 四川省成都市武侯区科华中路68号  
法定代表人: 陈萍  
联系人: 杨娟  
电话: 028—86025649  
客服电话: 96392  
公司网址: www.cdrcb.com  
(147) 名称: 深圳前海微众银行股份有限公司  
办公地址: 深圳市南山区铜鼓路39号大冲国际中心5号楼7层7D单元  
法定代表人: 薛峰  
联系人: 周强  
电话: 18767126283  
客服电话: 400—9828—211  
公司网址: www.xinniu1j1.com  
(148) 名称: 民商基金销售(上海)有限公司  
注册地址: 上海黄浦区北京东路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: 黄惠琴  
联系人: 杨一南  
电话: 021-60206003  
客服电话: 021-50206003  
公司网址: www.msftcc.com  
(149) 名称: 上海好实基金销售有限公司  
注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号  
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903—906室  
法定代表人: 杨文斌  
联系人: 王诗琦  
电话: 021-20613643  
客服电话: 400—700—9665  
公司网址: www.ehowbuy.com  
(150) 名称: 北京新浪仓石基金销售有限公司  
注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼518室  
办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼518室  
法定代表人: 李昭琛  
联系人: 李唯  
电话: 010-62675369  
客服电话: 010—62675369  
公司网址: www.xincail.com  
(151) 名称: 泰信财富基金销售有限公司  
注册地址: 北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8095房间  
办公地址: 北京市朝阳区建国路92号世茂大厦C—12  
法定代表人: 张庆  
联系人: 王玲玲  
电话: 400—404—8821  
客服电话: 400—004—8821  
公司网址: www.hxlc.com  
(152) 名称: 利和财富(上海)基金销售有限公司  
注册地址: 上海市虹口区四平路257号名义31D室  
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦31F  
法定代表人: 黄桂兰  
联系人: 张瑞吉  
电话: 13917630292  
客服电话: 021—31352052  
公司网址: www.lihe—fund.com  
(153) 名称: 北京展恒天基金销售有限公司  
注册地址: 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: 蒋辉  
联系人: 闫海勇  
电话: 010—58170950  
客服电话: 010—58170761  
网址: fund.shengshiview.com  
(154) 名称: 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: 北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层  
法定代表人: 丁东华  
联系人: 郭宝亮  
电话: 010—59287984  
客服电话: 400—111—0889  
公司网址: www.gomeifund.com  
(155) 名称: 中信证券(山东)有限责任公司  
注册地址: 山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001  
办公地址: 山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层  
法定代表人: 姜晓林  
联系人: 孙秋月  
电话: 0632—85022026  
客服电话: 96648  
网址: sd.citic.com  
(156) 名称: 北京徽鑫金融信息服务有限公司  
注册(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: 许现良  
联系人: 李雪  
电话: 010—56050820  
客服电话: 4001—500—882

公司网址: www.lanmao.com  
(157) 名称: 深圳信诚基金销售有限公司  
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: 深圳市福田区中心区东南部时代财富大厦49A  
法定代表人: 周文  
联系人: 殷浩然  
电话: 010-84865370  
客服电话: 0755—2394679  
公司网址: www.xcfund.com  
(158) 名称: 东莞证券股份有限公司  
注册地址: 东莞市莞城区可园南路一号  
办公地址: 东莞市莞城区可园南路一号  
法定代表人: 陈照星  
联系人: 李荣  
电话: 0769—22115712  
客服电话: 96328  
网址: www.dgzq.com.cn  
(159) 名称: 渤海证券股份有限公司  
注册地址: 江苏省常州延陵西路23号投资广场18层  
办公地址: 天津市滨海新区东广场1928号东海证券大厦  
法定代表人: 陈耀庭  
联系人: 王一塵  
电话: 021—20333333  
客服电话: 05631; 400—8888—588  
网址: www.longone.com.cn  
(160) 名称: 湘财证券股份有限公司  
地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路198号新城商务中心A栋11楼  
法定代表人: 孙永祥  
联系人: 李欣  
电话: 021—38784580  
客服电话: 96351  
网址: www.xcsc.com  
(161) 名称: 渤海证券股份有限公司  
注册地址: 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室  
办公地址: 天津市南开区云际道立达公寓F座渤海证券  
法定代表人: 王春峰  
联系人: 王星  
电话: 022—28451922  
客服电话: 400—651—5988  
网址: www.eeww.com.cn  
(162) 名称: 联储证券有限责任公司  
注册地址: 广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼  
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路333号金领大厦8楼  
法定代表人: 沙常明  
联系人: 丁倩云  
联系方式: 010—56177851  
客服电话: 400—620—6868  
公司网址: www.lczq.com  
(163) 名称: 华林证券股份有限公司  
注册地址: 拉萨市柳梧新区国际总部城3幢1单元5—5  
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  
联系人: 胡倩  
电话: 0755—83255199  
客服电话: 400—188—3888  
网址: www.chinalions.com  
(164) 名称: 河南和信证券投资顾问股份有限公司  
注册地址: 郑州市郑东新区金水东路南、农业东路西1号楼美盛中心2405  
办公地址: 郑州市郑东新区金水东路南、农业路西1号楼美盛中心2405  
法定代表人: 石磊  
联系人: 付俊峰  
电话: 0371—61777528  
客服电话: 0371—61777552  
公司网址: www.hexinsec.com  
(165) 名称: 中国民生银行股份有限公司  
注册地址: 北京市西城区复兴门内大街2号  
办公地址: 北京市西城区复兴门内大街2号  
法定代表人: 洪崎  
联系人: 穆晓  
电话: 010—56367136  
客服电话: 96568  
公司网址: www.cmbc.com.cn  
(166) 名称: 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006  
法定代表人: 洪弘  
联系人: 文雯  
电话: 010—83363101  
客服电话: 4001661188  
网址: www.xinlande.com.cn  
(167) 名称: 北京元达基金销售有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区东关大街11号11层1108号  
办公地址: 北京市朝阳区东关大街11号11层1108号  
法定代表人: 王伟刚  
联系人: 丁向坤  
电话: 010—56282140  
客服电话: 4006199059  
公司网址: www.yerichfund.com  
(168) 名称: 上海得信基金销售有限公司  
注册地址: 上海市宝山区蕴川路5475号1033室  
办公地址: 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  
法定代表人: 李兴春  
联系人: 郑英  
电话: 021—60583533  
传真: 021—60195218  
客服电话: 400—921—7755  
公司网址: www.iadfund.com.cn  
(170) 名称: 上海中正达广基金销售有限公司  
注册地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  
办公地址: 上海市徐汇区龙腾大道2815号302室  
法定代表人: 黄欣  
联系人: 戴晨  
电话: 021—33768132  
客服电话: 400—6767—523  
公司网址: www.zhongzhengfund.cn  
(171) 名称: 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: 上海市虹口区四川路700号普天信息产业园c5栋  
法定代表人: 金磊  
联系人: 魏静  
电话: 021—54647888  
客服电话: 400—820—2819  
公司网址: www.tychinaimr.com  
(172) 名称: 北京微众基金销售有限公司  
注册地址: 北京市石景山区古城南路113号景山财富中心341  
办公地址: 北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341  
法定代表人: 梁洪军  
联系人: 李长军  
电话: 010—52609656  
客服电话: 400—819—6665  
公司网址: www.buyforyou.com.cn  
(173) 名称: 大泰金石基金销售有限公司  
注册地址: 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楼  
法定代表人: 袁颖明  
联系人: 张永辉  
电话: 021—58373275  
客服电话: 400—928—2266/021—22267995  
公司网址: www.dtfunds.com  
(174) 名称: 珠海盈米基金销售有限公司  
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1201—1203室  
法定代表人: 肖雯  
联系人: 熊艳芳  
电话: 020—89629066  
客服电话: 020—89629066  
公司网址: https://www.yingmi.com/  
(175) 名称: 华泰证券股份有限公司  
注册地址: 江苏省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层、29层  
办公地址: 深圳市福田区深南中路6011号NEO(A座)35楼  
法定代表人: 吴祖芳  
联系人: 刘梦  
电话: 0755—23914941  
客服电话: 400—628—0888  
网址: www.htsc.com  
(176) 名称: 中民信托有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区东四环中路82号2座2—1层、2—2座7层; B2座—1座108单元  
办公地址: 北京市朝阳区东四环中路82号金长安大厦B7层  
法定代表人: 马宏波  
联系人: 李卉  
电话: 010—57412468  
客服电话: 4006881117  
公司网址: www.cdfo.com.cn  
(177) 名称: 信达证券股份有限公司  
注册地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人: 肖林  
联系人: 付博  
电话: 010—83251285  
客服电话: 96321  
网址: www.cindasc.com  
(178) 名称: 安信证券股份有限公司  
注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号  
办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1

座

法定代表人: 章宏韬  
联系人: 范超  
电话: 0651—6661921  
客服电话: 96318  
网址: www.haizq.com.cn  
(179) 名称: 新时点证券股份有限公司  
注册地址: 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
办公地址: 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
法定代表人: 叶顺德  
联系人: 田芳芳  
电话: 010—83561146  
客服电话: 4006989699或96399  
网址: www.xsdzq.com  
(180) 名称: 中山证券有限责任公司  
注册地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层  
办公地址: 深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层  
法定代表人: 林炳城  
联系人: 罗艺琳  
电话: 0755—82943755  
客服电话: 96329  
网址: www.zszq.com  
(181) 名称: 国融证券股份有限公司  
注册地址: 内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号四楼  
办公地址: 北京市西城区宣武门西大街甲129号金隅大厦16层  
法定代表人: 张智勇  
联系人: 叶睿林  
电话: 010—83991888  
客服电话: 96385  
网址: www.grzq.com  
(182) 名称: 粤开证券股份有限公司  
注册地址: 惠州市江北东江二路55号广播电视新闻中心西面一层大堂三楼304层  
办公地址: 深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层  
法定代表人: 严亦斌  
联系人: 彭鑫  
电话: 0756—83331195  
客服电话: 96564  
网址: www.ykzq.com  
(183) 名称: 广州证券有限公司  
注册地址: 哈尔滨市香坊区赣水路56号  
办公地址: 哈尔滨市松北区创新三路833号  
法定代表人: 赵海波  
联系人: 姜志伟  
电话: 0451—87765322  
客服电话: 400—666—2288  
网址: www.jhzq.com.cn  
(184) 名称: 英大证券有限责任公司  
地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层  
法定代表人: 郝京春  
联系人: 白桂  
电话: 0851—86824129  
客服电话: 4000—188—688;  
网址: www.ydsc.com.cn  
(185) 名称: 中国中金财富证券有限公司  
注册(办公)地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18—21层及第04层  
法定代表人: 马功勤  
联系人: 万玉琳  
电话: 0756—83202607  
客服电话: 95532; 4006008008  
网址: www.ciccwm.com  
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机构销售本基金。代销机构信息, 以基金管理人网站公示为准。  
(二) 注册登记机构  
名称: 金鑫基金管理有限公司  
注册地址: 广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79  
办公地址: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路28号越秀金融大厦30层  
电话: 020—38283037  
传真: 020—83282866  
联系人: 张磊  
(三) 出具法律意见书的律师事务所名称:  
名称: 广东岭南律师事务所  
住所: 广州市海珠区阅江中路370号广报中心北塔16楼  
法定代表人: 邓海峰  
电话: 020—81836088  
传真: 020—31952314  
经办律师: 欧阳兵、谢洁、伍瑞祥  
(四) 审计基金财产的会计师事务所名称:  
名称: 中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)  
名称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所: 中国北京长安街1号东方广场华马大楼8层  
法定代表人: 邹俊  
电话: +86(10) 85085000  
传真: +86(10) 85085111  
邮编: 100738  
经办注册会计师: 叶云晖、刘西茜  
四、基金的名称  
本基金名称: 金鑫货币市场证券投资基金  
基金简称: 金鑫货币市场基金  
基金代码: A类210012, B类210013  
五、基金的类型  
本基金类型: 契约型开放式  
六、基金的投资  
(一) 投资目标  
在力求保持基金资产本金的安全性和资产高流动性的基础上, 力争获得超过业绩比较基准的稳定收益。  
(二) 投资范围  
本基金投资于法律法规允许投资的金融工具, 具体范围如下:  
1、现金;  
2、期限在一年以内(含一年)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。  
如果法律法规或监管机构以后允许将其他基金投资品种纳入基金资产, 基金管理人将在履行适当程序后将其纳入投资范围。  
(三) 投资策略  
本基金结合“自上而下”和“自下而上”的研究方法对各类可投资资产进行合理配置和选择。本基金综合考虑各类资产的收益性、流动性及风险性, 在风险和收益的配比基础上, 力求将各类风险投资品种, 基金管理人将在履行适当程序后将其纳入投资范围。  
(四) 资产配置策略  
1. 整体资产配置策略  
本基金将根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断, 然后形成利率动态预期, 进而调整本基金投资组合的平均剩余期限。  
(1) 利率分析策略  
本基金通过对通货膨胀、GDP 增长、货币供应量、国际利率水平、汇率、政府财政政策等因素进行分析, 形成对基本面的宏观研判。同时, 对中国人民银行公开市场操作、主流机构发布的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场监管层面的因素进行考察, 合理预期货币市场利率变动变化, 以此确定基金投资组合平均剩余期限。  
(2) 久期管理策略  
当预期市场利率上升时, 基金管理人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; 在预期市场收益率下降时, 通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期, 以分享债券价格上升的收益。  
2. 类属配置策略  
本基金将合理配置各类短期金融工具, 如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金类投资品种, 通过类属配置满足基金流动性需求并获得投资收益。本基金将对市场整体面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析, 在高流动性资产和流动性较低资产之间寻找平衡, 以满足组合的日常流动性需求; 基金管理人通过对各类属的相对收益、利率变化、流动性风险、信用风险等因素的分析来确定类属配置比例, 选择具有投资价值品种, 以获取较高回报。  
3. 债券资产配置策略  
本基金以安全性为第一考量, 优先选择央票、短期国债等高信用等级品种以回避信用违约风险。本基金还可配置信用等级信用评级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类资产。在具体品种选择上, 基金管理人将在正确识别收益率曲线的基础上, 客观分析收益率偏离品种的原因, 寻找收益率明显偏高的品种。本基金将重点关注价格被低估品种。  
4. 流动性管理策略  
本基金将结合基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素进行跟踪, 对投资组合的现金比例进行结构化管理, 使得基金具备较高的流动性。基金管理人将综合考虑基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例, 通过现金留存、持有高流动性债券、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性, 将回购或债券的到期日进行均衡等量配置, 以确保基金资产的变现需求。  
5. 逆回购策略  
基金管理人将密切关注由于季节性需求、新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会, 通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率提升的投资机会。  
(四) 业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为一年定期存款利率(税后), 即:  
(1—利息税率)×一年定期存款利率  
(五) 风险收益特征  
本基金属于高流动性、低风险品种, 其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。  
(六) 投资禁止行为与限制  
1. 禁止行为  
(1) 承销证券;  
(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;  
(3) 从事承担无限责任的投资;  
(4) 买卖其他基金份额, 但国务院证券监督管理机构另有规定的除外;  
(5) 向基金管理人、基金托管人出资;  
(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;  
(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。  
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合本基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交

易必须事先得到基金托管人同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。  
如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 基金管理人将在履行适当程序后不受上述规定的限制。  
2. 基金投资组合比例调整  
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的, 基金管理人应在10个工作日内进行调整。  
(七) 投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限的计算方法  
1. 计算公式  
本基金按下列公式计算平均剩余期限:  
(Σ投资于金融工具产生的资产×剩余期限-Σ投资于金融工具产生的负债×剩余期限+债券正回购×剩余期限)÷(投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+债券正回购)  
按下列公式计算平均剩余存续期限:  
(Σ投资于金融工具产生的资产×剩余存续期限-Σ投资于金融工具产生的负债×剩余存续期限+债券正回购×剩余存续期限)÷(投资于金融工具产生的资产-投资于金融工具产生的负债+债券正回购)  
其中: 投资于金融工具产生的资产包括现金; 期限在一年以内(含一年)的银行存款、同业存单、逆回购、中央银行票据; 剩余期限在397天以内的资产支持证券、非金融企业债务融资工具; 买断式回购产生的待回购债券; 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。  
投资于金融工具产生的负债包括债券回购在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。  
采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价; 贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应计利息。  
2. 各类资产和负债剩余期限、剩余存续期限的确定方法  
(1) 银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天; 证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;  
(2) 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;  
(3) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限、待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;  
(4) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期的实际剩余天数计算;  
有存款期限, 根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款, 剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期的实际剩余天数计算; 银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算;  
(5) 中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算;  
(6) 本基金资产组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数, 以下情况除外:  
本基金投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算; 剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。  
(7) 对其它金融工具, 基金管理人将基于审慎原则, 根据法律法规和中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。  
平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位, 小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限计算方法另有规定的从其规定。  
七、基金投资组合报告(未经审计)  
本基金管理人的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。  
本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的规定, 复核了本报告中的内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本投资组合报告有关数据截止日为2019年9月30日, 本报告中所有财务数据未经审计。  
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	7,867,318,429.91	52.90
	其中:债券	7,697,141,474.54	51.76
	资产支持证券	170,176,955.37	1.14
2	买入返售金融资产	5,263,278,444.91	34.99
	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	1,796,237,843.94	11.88
4	其他资产	34,322,377.36	0.23
5	合计	14,971,167,096.12	100.00

注: 其他资产包括: 交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

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	4.61	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
2	报告期末债券回购融资余额	906,636,517.54	6.50
	其中:买断式回购融资	-	-

注: 上表中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个交易日融资余额占基金资产净值的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值50%的说明:  
本基金本报告期债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的20%。