

嘉实现金添利货币市场基金更新招募说明书摘要

(2020年1月23日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示
嘉实现金添利货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2014年4月28日证监许可[2014]442号文《关于核准嘉实现金添利货币市场基金募集的批复》注册募集，并于2015年3月23日经机构部函[2017]793号《关于嘉实现金添利货币市场基金定期募集备案的回函》确认。本基金基金合同于2017年3月29日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金前应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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，并授权《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本次更新招募说明书是与修订基金合同、托管协议相关的内容，包括“重要提示”、“释义”、“基金合同的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金资产的估值”、“基金的信息披露”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节，并对基金管理人、基金托管人等信息一并更新。

一、基金管理人

1. 基本信息	
名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街2号华润大厦9层
法定代表人	杨锐
成立日期	1999年03月25日
注册资本	12.0亿元
股权结构	中信证券股份有限公司40%、DWS Investments Singapore Limited30%、立信投资有限公司10%
存续期间	持续经营
电话	010-59381888
传真	010-59381678
联系人	胡昕

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

（二）主要人员情况
1. 基金管理人董事、监事、总经理及其他管理人员基本情况
牛成先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部主任；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资担保业务工作组（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视研究所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津物产原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017年12月起任公司董事长。

朱薇女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任证监会财会部资金运用处主任科员、国债证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

韩家庆先生，董事，1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今，任北京德恒律师事务所总经理；2001年11月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

Mark H.Cullen先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD，德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD，德意志银行（伦敦）首席运营官，德意志银行全球资产主管。现任EDW Management GmbH执行董事，全球首席运营官。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团市场部副总裁。自1996年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院金融数学专业硕士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编、汤晖霖路德集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现任上海证券交易所上市公司委员会、中国证监会、中国上市公司协会独立董事委员会主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学会计学教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼MBA教育中心主任。

经雷先生，董事、总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年至2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国总部担任研究投资顾问。2008年至2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起为公司总经理。

张树涛先生，监事长，经济学家，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理，光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理有限公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长、中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢律师，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

罗丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平安人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法律经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监，现任基金运营总监。

宋振娟女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市清浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

2. 代销机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国银行股份有限公司	办公地址：中国北京市复兴门内大街1号 法定代表人：董庆伟 电话：010-65959690 传真：010-65959696 网址：http://www.bocm.com
2	四川天府银行股份有限公司	办公地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段92号28楼 法定代表人：冯运 电话：028-42767033 传真：028-42767033 网址：http://www.tfbc.com
3	嘉实财富管理有限公司	办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期20层 法定代表人：赵学军 联系人：张宇 电话：021-20228900 传真：021-20228110 网址：http://www.harvestwm.com
4	众安财新北京基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区东三环北路27号盈科中心301室 法定代表人：李宇明 联系人：魏琦 电话：010-59380222 传真：010-59380222 网址：http://www.harvestwm.com
5	大连网金基金销售有限公司	办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2F 法定代表人：樊怀怀 联系人：魏琦 电话：0411-30207828 传真：0411-30207828 网址：http://www.wyfund.com
6	中国财富金融创新上海有限公司	办公地址：上海市浦东新区平塘路8号101层 法定代表人：胡健 联系人：魏琦 电话：021-33268092 传真：021-33268092 网址：http://www.cfwe.com
7	东方财富证券股份有限公司	办公地址：上海市徐汇区东平路1号 法定代表人：陈万里 联系人：魏琦 电话：021-50583030 传真：021-50583030 网址：http://www.wenji.com
8	阳光人寿保险股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路12号院1号楼6层 法定代表人：李科 联系人：魏琦 电话：010-59653000 传真：010-59653000 网址：http://tinsure.com

李耀先生，硕士研究生，10年证券从业经历，具有基金从业资格。曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014年12月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短债alpha策略组。2015年5月14日至2018年11月2日任嘉实理财7天债券型证券投资基金基金经理。2015年1月28日至2019年4月21日任嘉实活期宝货币市场基金基金经理。2016年12月22日至2019年4月21日任嘉实现金添利货币市场基金基金经理。2017年4月13日至2019年4月21日任嘉实现金添利货币市场基金基金经理。2017年5月24日至2019年4月21日任嘉实超短债债券型证券投资基金基金经理。2019年5月25日至2019年9月26日任嘉实中证短债债券型证券投资基金基金经理。2019年5月30日至2019年9月26日任嘉实中短债债券型证券投资基金基金经理。2019年6月5日至2019年9月26日任嘉实中证中短债债券型证券投资基金基金经理。2019年9月26日至2019年9月26日任嘉实中证中短债债券型证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理
万晓西先生，管理时间为2017年3月29日至2019年8月30日。

3. 债券投资决策委员会
债券投资决策委员会的成员包括：公司总经理兼固定收益业务首席投资官雷先雷先生、固定收益体系策略组组长王善女士、胡永青先生、王怀宸先生。

4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖亿贰仟肆拾玖亿元
法定代表人：刘连舸
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24号
托管部门信息披露联系人：许俊
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具备海外工作经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金（基金—一对多）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、ODII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况
截至2019年12月31日，中国银行已托管764只证券投资基金，其中境内基金722只，ODII基金42只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度
中国银行托管业务部内部控制管理工作是中国银行全面风险控制工作的重要组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部内部控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAPO1/06”、“ISAE3402”和“ISAE3416”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SAB16”双准则的内控审阅审计报告。中国银行托管业务内部控制完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1. 直销机构
（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址：北京市东城区建国门内大街9号北京财富中心D座12层
电话：010-66215688 传真：010-66215677
联系人：胡昕

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
电话：021-38796668 传真：021-38796663
联系人：胡昕

（3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址：成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座1210室
电话：028-18622100 传真：028-18622100
联系人：王丽娜

（4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址：深圳市福田区滨河路1001号太平金融大厦16层
电话：0755-44382290 传真：0755-28970903
联系人：陈翠珊

（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址：青岛市市南区东海西路36号亨泰大厦1301室
电话：0632-16977797 传真：0632-16977676
联系人：胡昕

（6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址：杭州市下城区东新路288号新城市广场1001A室
电话：0571-18909132 传真：0571-18902139
联系人：王娜

（7）嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址：福州市鼓楼区五四路137号信合广场901A单元
电话：0591-18801370 传真：0591-188013670
联系人：吴志峰

（8）嘉实基金管理有限公司南昌分公司

办公地址：南昌市西湖区红谷滩新区366号新城市广场1001A室
电话：0791-189671118 传真：0791-189671100
联系人：徐晶晶

（9）嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区珠江新城6号广州国际金融中心主楼103、200单元
电话：020-188852126 传真：020-18162120
联系人：魏琦

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国银行股份有限公司	办公地址：中国北京市复兴门内大街1号 法定代表人：董庆伟 电话：010-65959690 传真：010-65959696 网址：http://www.bocm.com
2	四川天府银行股份有限公司	办公地址：四川省南充市顺庆区滨江中路一段92号28楼 法定代表人：冯运 电话：028-42767033 传真：028-42767033 网址：http://www.tfbc.com
3	嘉实财富管理有限公司	办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期20层 法定代表人：赵学军 联系人：张宇 电话：021-20228900 传真：021-20228110 网址：http://www.harvestwm.com
4	众安财新北京基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区东三环北路27号盈科中心301室 法定代表人：李宇明 联系人：魏琦 电话：010-59380222 传真：010-59380222 网址：http://www.harvestwm.com
5	大连网金基金销售有限公司	办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2F 法定代表人：樊怀怀 联系人：魏琦 电话：0411-30207828 传真：0411-30207828 网址：http://www.wyfund.com
6	中国财富金融创新上海有限公司	办公地址：上海市浦东新区平塘路8号101层 法定代表人：胡健 联系人：魏琦 电话：021-33268092 传真：021-33268092 网址：http://www.cfwe.com
7	东方财富证券股份有限公司	办公地址：上海市徐汇区东平路1号 法定代表人：陈万里 联系人：魏琦 电话：021-50583030 传真：021-50583030 网址：http://www.wenji.com
8	阳光人寿保险股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路12号院1号楼6层 法定代表人：李科 联系人：魏琦 电话：010-59653000 传真：010-59653000 网址：http://tinsure.com

上海控制基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦东南路799号3楼
法定代表人：王春峰
联系人：李海
电话：021-58303379
传真：021-58303379
网址：http://www.shzhfund.com

北京百度百基金销售有限公司
办公地址：北京市海淀区中关村大街101号1101
法定代表人：杨文斌
联系人：魏琦
电话：010-61913627
传真：010-61913627
网址：http://www.baijifund.com

和讯信息科技有限公司
办公地址：上海市浦东新区东陆路5668号3楼
法定代表人：王莉
联系人：李晔
电话：021-20835300
传真：021-20835300
网址：http://www.hexun.com

南京途牛金融信息服务有限公司
办公地址：南京市鼓楼区江东中路222号19楼
法定代表人：宋娟
联系人：魏琦
电话：025-96883600
传真：025-96883600
网址：http://www.tuniu.com

（二）登记机构

名称：嘉实基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
办公地址：北京市建国门内大街9号中国国金中心二期27楼09-14单元
法定代表人：杨锐
联系人：彭鑫
电话：010-66215688
传真：010-66185678

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海锦泰律师事务所
住所：办公地址：上海市浦东新区浦东南路266号华夏银行大厦14楼
负责人：廖海
联系人：李晔
电话：（021）51150298-827 传真：（021）51150398
经办律师：刘佳、张兰

（四）审计基金财产的会计师事务所

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号展业大厦507单元01室
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号瑞华商务中心二座11楼
法定代表人：李丹
联系人：魏琦
电话：（021）23238888 传真：（021）23238800
经办注册会计师：魏琦、魏琦

四、基金名称
嘉实现金添利货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的绝对收益。

七、基金的投资范围
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、银行存款、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；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；以及中国证监会、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。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略
在严谨深入的研究分析基础上，本基金综合考虑市场资金面走向、存款银行的信用资质，以及各类资产的风险、收益率水平、流动性特征等，确定各类资产的配置比例。

2. 组合久期投资策略
根据对市场收益率水平变化趋势的判断，本基金动态调整组合久期，以谋求控制风险、增加或锁定收益。当预期市场收益率水平上升时，本基金适当降低组合久期；当预期市场收益率水平下降时，本基金适当增加组合久期。

3. 银行存款投资策略
本基金根据不同银行的银行存款收益情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整体市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值且流动性较好的投资。

4. 利用短期市场机会的灵活策略
由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡，新股、新债发行以及未达效应等因素会通过市场资金供求发生短时的失衡，这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

5. 投资决策
(1) 决策依据
1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2) 宏观经济、微观经济运行状况、货币政策和财政政策执行状况、货币市场和证券市场运行状况；
3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

(2) 决策程序
1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的整体投资策略，审核并批准基金提出的资产配置方案或重大投资决策。
2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。
3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。
4) 交易部门依据基金投资的指令，制定交易策略并执行交易。
5) 监察稽核部门负责监控基金的投资管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部运用风险监控模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款税后利率
活期存款是具备最高流动性的存款，本基金期望通过科学严谨的管理，使本基金达到类货币活期存款的流动性以及更高的收益，因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

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。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整当日2日在中国证监会指定媒介上刊登公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险控制特征
本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

十一、基金的投资报告
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。

本基金托管人中国银行根据本基金合同规定，于2019年1月17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12月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	固定收益投资	26,276,041,788.97	97.31
	其中：债券	26,276,041,788.97	97.31
2	货币资金	6,276,890,556.31	7.79
	其中：买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	35,548,989,589.66	62.47
4	其他资产	1,643,241,074.32	2.43
5	合计	67,746,153,015.34	100.00

2. 报告期末债券回购融资情况

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	16.32
	其中：买断式回购融资	-
2	报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例	11.26
	其中：买断式回购融资	-

注：（1）报告期内债券回购融资余额为报告期末每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例均为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。**（2）**本基金基金合同第十二部分约定：债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	109

注：报告期末每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

（2）报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	期限	报告期内基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	16.50
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	11.26
2	30天（含）-90天	15.18
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
3		