

## B 信息披露 Disclosure

## (上接B205版)

法人代表:郭坚  
注册地址:15921300165  
联系人:程晨  
客服电话:400-996-6618  
网址:www.litcom.com  
(92)北京恒天明泽基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区东方路10号5层05122室  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路27号嘉铭中心B座10层  
法人代表:梁晟  
电话:18641514414  
办公地址:北京市朝阳区中关村大街11号11层1108号  
客服电话:400-998-0618  
网址:www.chtfund.com  
(93)上海长量基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区高路路526号2幢220室  
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层  
法人代表:袁颖倩  
电话:021-20691832  
联系人:詹勇  
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:北京市丰台区东管庄192号楼2-45室  
办公地址:北京朝阳区望京亚力山大中心A座9层  
法人代表:吴昊  
电话:010-59363619  
联系人:孙雯  
客服电话:010-59336512  
网址:www.jule.com  
(95)北京汇成基金销售有限公司  
注册地址:北京市西城区宣武门大街1号1号楼1616103室  
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙楼二层  
法人代表:胡伟  
电话:18513890605  
联系人:陈静雨  
客服电话:400-068-1176  
网址:www.hicfund.com  
(96)聚安财富管理有限公司  
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:赵亚男  
电话:010-400842306  
联系人:李雯  
客服电话:400-021-8850  
网址:www.harvestwm.cn  
(97)北京钱景基金销售有限公司  
注册地址: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6号丹棱soho1008-1012  
法人代表:赵亚男  
电话:010-57418813  
联系人:陈剑伟  
客服电话:400-893-6885  
网址:www.qianjin.com  
(98)中国人寿保险股份有限公司  
注册地址:中国北京市西城区金融大街16号  
办公地址:中国北京市西城区金融大街16号  
法定代表人:王苏  
电话:010-63631539  
联系人:秦泽伟  
客服电话:96519  
网址:www.chinalife.com  
(99)天相投资顾问有限公司  
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701  
办公地址:北京市西城区金融大街8号新盛大厦B座4层  
法人代表:林文君  
电话:010-66045608  
联系人:赵影珍  
客服电话:010-66045555  
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1层  
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号文化创意工场四层404  
法人代表:徐福君  
电话:18585981  
联系人:王晨  
客服电话:400-600-0030  
网址:www.bzfunds.com  
(101)深圳盈嘉基金销售有限公司  
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:深圳市南山区招商大道12号惠恒集团二期418室  
法人代表:李海  
电话:0755-83999077-806  
联系人:黄良红  
客服电话:0755-83999077  
网址:www.jinjiawen.com  
(102)北京国融汇信投资咨询有限公司  
注册地址:北京市西城区永定门大街2号百景街10号2幢236室  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心30层  
法人代表:张冠宇  
电话:010-85932810  
联系人:王丽敏  
客服电话:400-819-0988  
网址:www.griid.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号外滩国际广场19楼  
办公地址:上海市中山南路700号普天信息产业园2期C5栋5层E单元总部大楼2楼  
法人代表:冯修敏  
电话:18001713632  
联系人:李海  
客服电话:021-34013996  
网址:www.hotijin.com  
(104)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋101006号  
办公地址:北京市西城区宣武门大街28号富都大厦1506室  
法人代表:杨洁  
电话:18502264557  
联系人:文雯  
客服电话:400-166-1188  
网址:8rj.com.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:黄欣  
电话:13744232592  
联系人:戴珉璐  
客服电话:400-676-7523  
网址:www.zzwalth.com  
(106)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369号国睿大厦一号楼B区4A506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:袁颖明  
电话:15921264785  
联系人:赵明  
客服电话:400-929-2296  
网址:www.dttfund.com.cn  
(107)北京蛋卷基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507  
办公地址:北京市朝阳区创远路34号院融科科技中心C座17层  
法人代表:钟斐斐  
电话:1691040297  
联系人:侯芳芳  
客服电话:400-061-8518  
网址:www.ncj.com  
(108)徽商银行股份有限公司  
住所:安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座  
办公地址:安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座  
法定代表人:陈光武  
电话:0551-65861113;18055189068  
联系人:周臻  
客户服务热线:40088-96588  
网址:www.hsbank.com.cn  
(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1005室  
办公地址:上海浦东新区陆家嘴151弄9号1010号12楼  
法人代表:李兴春  
电话:18901780806  
联系人:陈洁  
客服电话:400-921-7733  
网址:www.lidfund.com.cn  
(110)上海聚泰基金销售有限公司  
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518号8层  
法人代表:燕斌  
电话:021-52322063  
联系人:陈东  
客服电话:400-046-6788  
网址:www.juetaifund.com  
(111)北京新浪乐石基金销售有限公司  
注册地址:北京市海淀区北四环西路68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10号泰康大厦12楼  
法定代表人:张琪  
电话:18611773539  
联系人:李娜  
客服电话:400-021-62676979  
网址:www.xincail.com  
(112)北京盈信基金销售有限公司  
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号  
法定代表人:许洪良  
电话:15614605020  
联系人:李雪  
客服电话:400-150-0882  
网址:www.lianmai.com/mymoney  
(113)北京广源达投资管理有限公司  
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层8005室  
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼海润中心B座19层  
法人代表:齐剑野  
电话:15201586214  
联系人:王水璐  
客服电话:400-623-6060  
网址:www.nianmifund.com  
(114)深圳前海微众银行股份有限公司  
注册地址:深圳前海深港现代服务业合作区南山街道901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:高伟  
电话:0755-83665588-605  
联系人:廖福海  
客服电话:400-894-8688  
网址:www.microweb.com.cn  
(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:徐亚娟  
客服电话:400-820-9463  
网址:www.wind.com.cn  
(116)浦银基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室  
办公地址:北京市朝阳区望京丽泽中心A座8层04-08  
法定代表人:李相得  
电话:18611256407  
联系人:李艳  
客服电话:400-069-8888

网址:www.wy-fund.com  
(117)北京肯瑞财富投资管理有限公司  
(117)北京肯瑞财富投资管理有限公司  
注册地址:北京市北京经济技术开发区科创十一街18号C座2层221室  
办公地址:北京市北京经济技术开发区科创十一街18号C座2层222室  
法定代表人:江升  
电话:1861259049  
联系人:黄立晋  
客服电话:400-888-0816  
网址:fund.tcm.com  
(118)上海汇成基金销售有限公司  
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号  
办公地址:北京市朝阳区中关村大街11号11层1108号  
法定代表人:王伟刚  
电话:18001102931  
联系人:丁向冲  
客服电话:400-619-0169  
网址:www.hicfund.com  
(119)基普普瑞投资顾问(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国路88号1501室1501B909  
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:13520443582  
联系人:张博恒  
客服电话:400-4099-200  
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桂湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳南山区海德三路海岸大厦东座111室及1307室  
法定代表人:T.EOWEIHOWE  
电话:13424261401  
联系人:叶培  
客服电话:400-684-0500  
网址:www.ifastps.com  
(121)北京创金启富投资管理有限公司  
注册地址:北京市西城区白广胡同31号5号楼215A  
办公地址:中国北京西城区广外大街2号经济日报社A座综合楼712号  
电话:15203205050  
联系人:王刚  
客服电话:400-626-2818  
网址:www.5icich.com  
(122)北京格上富信基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701103室  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701103室  
法定代表人:安立庆  
电话:1560035787  
联系人:张林  
客服电话:400-080-5828  
网址:www.ligong.com  
(123)嘉实基金销售有限公司  
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海嘉实经  
济区)

办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1603-1604室  
法定代表人:王翔  
电话:17721005485  
联系人:关涛飞  
客服电话:400-820-5369  
网址:www.jiayifund.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:朝阳区来广营中街甲1号朝来高科技产业园3号楼  
法定代表人:程刚  
电话:1521022910  
联系人:陈旭  
客服电话:400-810-5919  
网址:www.fengf.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:上海浦东新区东方路900号宝安大厦7、8、10楼  
法定代表人:李圣军  
联系人:史艺雯  
电话:18701852901  
客服电话:400-888-7868  
网址:www.syhq.com  
(126)乾道盈泰基金销售有限公司(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环北路17号院1717室  
办公地址:北京市朝阳区德外大街合生财富广场1302室  
法定代表人:王兴吉  
联系人:马林  
电话:18810292781  
客服电话:400-089-8080  
网址:www.qiandao.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1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1层1108  
法定代表人:赖建军  
联系人:魏文斌  
电话:0755-29330513  
客服电话:400-930-0660  
网址:www.jfzinv.com  
(128)北京植信基金销售有限公司  
注册地址:北京市密云县云来里南园8号楼2号楼106室-67  
办公地址:北京市朝阳区东三环北路17号院1717室  
法定代表人:杨晓飞  
联系人:吴鹏  
电话:18701358525  
客服电话:4006-802-123  
网址:www.zhixin-inv.com  
(129)上海凯石财富基金销售有限公司  
(129)上海凯石财富基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1502号17楼7-115室  
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4F  
法定代表人:陈继武  
联系人:高懿峰  
电话:1361784145  
客服电话:121-6333-3389-230  
网址:www.shiestone.com  
(130)杭州蚂蚁财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:杭州市下城区上塘路15号武林时代22楼  
法定代表人:陈刚  
联系人:张珺  
电话:15266656590  
客服电话:021-88826520  
网址:www.karzq.com.cn  
(131)上海阳禾统鑫基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区张江路600号4号2号楼  
办公地址:上海市浦东新区张江路600号4号2号楼  
联系人:陆启青  
电话:15902135304  
客服电话:400-998-7772  
网址:www.99fund.com  
(132)嘉实基金销售有限公司  
注册地址:天津市南开区内大街13号嘉实基金销售有限公司  
办公地址:天津市南开区内大街13号嘉实基金销售有限公司  
法定代表人:孙伟  
电话:15510486151  
联系人:孙薇  
客服电话:400-882-2993  
网址:www.jszxfund.com  
(133)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:王锋  
电话:025-66996999-897226  
联系人:王静  
客服电话:95177  
网址:www.snjifund.com  
(134)上海挖财基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路700号5011.02.03室  
办公地址:上海市浦东新区张江路600号5011.02.03室  
法定代表人:胡伟斌  
电话:021-50810687  
联系人:刘娟  
客服电话:400-025-6669  
网址:www.wacaijin.com  
(137)中民财富管理(上海)有限公司  
注册地址:上海市黄浦区四川路100号1005室  
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层  
法定代表人:李勇  
电话:400-025-6669  
联系人:李娜  
客服电话:400-025-6669  
网址:www.zmwm.com.cn  
(138)天津自贸区(中心商务区)迎夏大道1989号滨海新区大厦单元2-2413室  
办公地址:北京市朝阳区丰瑞国际2号太平洋保险大厦A座5层  
法定代表人:李修峰  
电话:13811914697  
联系人:王静  
客服电话:010-59013828  
网址:www.wasnet.com  
(139)泰泰财富(青岛)基金销售有限公司  
(139)泰泰财富(青岛)基金销售有限公司  
注册地址:山东省青岛市香港东路105号9号楼701室  
办公地址:北京市朝阳区西四环北路31号院九思文创业园6号楼011室  
法定代表人:任淑娟  
电话:010-48121830  
联系人:周晓璇  
客服电话:0632-66728591  
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栋2楼268室  
办公地址:上海市虹口区东大名路687号1栋2楼268室  
法定代表人:毛春平  
电话:13810430687  
联系人:张静怡  
客服电话:400-876-6716  
网址:www.amcfund.com  
(141)蚂蚁财富基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市西湖区东新路4号102室  
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥东路康庄国际中心B座602、603房间  
法定代表人:毛春平  
电话:13810430687  
联系人:张静怡  
客服电话:400-360-4000  
网址:www.fund123.com.cn  
(142)通华财富(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

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融大厦7楼杨高南路790号3号楼9楼  
法定代表人:马刚  
电话:021-60810686  
联系人:杨涛  
电话:18612591156  
网址:www.tonghuafund.com  
(143)大连净富基金销售有限公司  
注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室  
办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室  
法定代表人:樊伟东  
电话:1860272808  
联系人:贾伟刚  
客服电话:4000-899-100  
网址:www.yitaijin.com  
(144)西藏东方财富证券股份有限公司  
注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10号楼  
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦16楼  
法定代表人:陈涛  
电话:021-22686603  
联系人:付佳  
客服电话:96357  
网址:www.18.cn  
(145)江苏汇林保大基金销售有限公司  
注册地址:南京市高淳区经济开发大道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:吴言林  
电话:16621719458  
联系人:黄子娟  
客服电话:025-66646166  
网址:www.huilinbd.com  
(146)元证国际代理有限公司  
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  
电话:13726282013  
联系人:李亚菲  
客服电话:021-50710163  
网址:www.xiyinsu.com;7100/klt\_xybh  
(147)北京展恒天下一基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区九渡河绿黄旗村736号03室  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号通顺中心D座28层  
法定代表人:蒋璐  
电话:18610132113  
联系人:史晓霞  
客服电话:400-0766-123  
网址:www.fund123.com (149)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2号楼东方财富大厦2楼  
办公地址:上海市徐汇区龙田路105号302室  
法定代表人:具爽  
电话:18611770-5311  
联系人:丁姗姗  
客户服务热线:400-181-8188  
网址:www.1234567.com.cn  
(150)上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区四川中路390弄37号4楼449室  
办公地址:上海市浦东新区东川路500号东方财富大厦9楼(200120)  
法定代表人:杨文斌  
电话:13661870024  
联系人:徐超逸  
客户服务热线:400-700-9665  
网址:www.ehowbuy.com  
(151)浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址:浙江杭州市文二西路122号903室  
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼  
法人代表:吴强  
电话:13675961499  
联系人:吴杰  
客服电话:400-877-3772  
网址:www.5ifund.com  
(152)和讯信息科技有限公司  
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
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:18612296161  
联系人:张洪亮  
客服电话:010-85657576  
网址:www.licaike.com  
(二)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:天津市滨海新区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层  
联系人:李明娟  
电话:022-18395660  
传真:022-18395663  
联系人:薄晋龙  
(三)律师事务所和经审计的会计师事务所  
名称:天津嘉德世纪律师事务所  
地址:天津市滨海新区马场道59号天津国际经济贸易中心A座1009-1010  
法定代表人:范卫民  
电话:022-18395255  
传真:022-18395266  
联系人:李宏帆  
经办律师:韩刚、续宏帆  
(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: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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:李丹  
电话:021-23238888  
传真:021-23238900  
经办注册会计师:薛岚、周坤  
联系人:周坤

## 四、基金份额的分级

(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。本基金将设A级、B级、C级、D级和E级五类基金份额,五类基金份额单独设置基金代码,并单独公布基金份额净值和基金份额累计净值。  
本基金A级基金份额的基金代码为A00006,B级基金份额的基金代码为A20106,C级基金份额的基金代码为A00032,D级基金份额的基金代码为A00033,E级基金份额的基金代码为A00034。  
本基金实际运作情况,在履行适当程序后,基金管理人可对基金份额分级情况进行调整并公告。  
(二)基金份额的赎回限制  
投资者可以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,但根据《基金合同》约定因申购、赎回而发生基金份额自动升级或降级的除外。  
本基金A级、B级、C级、D级和E级基金份额的数量限制如表1:

表1.基金份额的基金份额限制		A级		B级		C级		D级		E级	
首次申购最低金额	1,000元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元
追加申购最低金额	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元	100元
单一账户内基金份额的最低份额	500份	500份	0.01份	0.01份	0.01份	0.01份	0.01份	0.01份	0.01份	0.01份	0.01份
销售服务费年费率	0.25%	0.01%	0.2%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%

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,调整申购各级基金份额的最低金额限制及规则,基金管理人必须至少在开始调整之日前3日至少在指定媒介公告。  
(三)基金份额的自动升降级  
根据《基金合同》约定,申购A级基金份额超过500万份(含)时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户1持有的所有基金份额升级为B级基金份额。投资者在持有同一账户中保留的B级基金份额最低金额为500万份(含),否则本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户1持有的所有基金份额降为A级基金份额。  
C级基金份额、D级基金份额和E级基金份额不进行基金份额升降级。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,基金管理人必须至少在开始调整之日前3日至少在指定媒介公告。

## 五、基金的名称

本基金名称:天弘现金管家货币市场基金

## 六、基金的类型

本基金类型: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较低流动性的前提下,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、资产支持证券等;  
(4)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。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

## 九、基金的投资策略

## (一) 资产配置策略

本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动型投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对金融工具积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益。

## 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利率变动变化预测,动态调整组合久期。当预期市场短期利率上升时,根据不同类型的资产收益水平(各剩余期限到期收益率、利息支付方式和对利率敏感性),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)和期限特征(信用等级、流动性),决定各类资产的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性因素,选择央票、短期国债等高信用等级债券品种进行投资以规避风险。在基金投资的个券选择上,本基金首先将各种债券的信用等级、剩余期限(或持有)日均成交量和平均持有成本(或到期)进行初步筛选,然后根据各种债券的收益率和流动性的结构合理性,评估其投资价值,进行再次筛选;最后,根据各种债券的到期收益率变动与可投资量(投资量、日均成交量与持仓成本)决定具体投资比例。

## 3. 久期策略

本基金根据对未来短期利率走势的判断,结合货币市场基金资产的高流动性要求及其相关的流动性风险,动态调整组合久期。当预期市场短期利率上升时,本基金将适当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,以降低组合久期;当预期市场短期利率下降时,则适当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

根据回购利率利率走势变化情况,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,利用正回购操作融入资金进行债券投资,提高资金使用效率。

## 5. 套利策略

不同交易场所或不同交易品种受参与群体、交易模式、环境冲击、流动性等因素影响而出现定价差异,从而产生套利机会。本基金在充分论证这种套利行为可行的基础上,适度进行跨市场跨品种套利操作,提高资产收益率。如跨银行间和交易所的跨市场套利,期限收益结构偏移中的不同期限品种的互换操作(跨期限套利)。

## 6. 现金流管理策略

本基金根据对货币市场工具具有较高流动性的要求,本基金将根据市场环境分析分析及对投资组合的流动性需求,通过调整投资组合的期限结构搭配,动态调整并有效分散基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。

## (二) 投资决策

## 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)国内宏观经济形势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策取向及全球宏观经济分析。

## 2. 投资管理程序

(1) 投资决策的形成与维持  
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利差(OAS)对普通债券和含权债券进行分类分析,在此基础上形成基金债券投资组合推荐。

(2) 资产配置会议  
本基金管理人定期召开资产配置会议,讨论基金的资产组合以及个券配置,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,根据本基金的资产配置要求,参考资产配置会议、投研会议讨论结果,制定基金的投资策略,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。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,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  
基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况,风险管理部与监察稽核部负责对基金投资组合进行日常监控,风险管理部与稽核部定期对基金投资组合进行风险评估,基金经理定期对证券市场变化和基金投资组合形成和运行进行总结评估,对基金投资组合不断进行调整和优化。

## 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(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,存取方便灵活,存取方式多样,同时可获得高于活期存款的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的资产组合、投资目标及流动性特征,本基金选择同期七天通知存款利率(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,或者有其他代表性更强、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。

## 十一、基金投资组合报告

本基金为货币市场基金,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

基金管理人的董事会及董事保证所披露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。

基金会计中账簿记录与报表数据一致,会计核算系统能本基金合同约定披露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,本报告中所列财务数据未经审计。以下内容摘自本基金2019年第四季度报告:

## 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额单位:人民币元	
		金额	占基金总资产比例(%)
1	固定收益投资	6,136,960,715.21	42.62
	其中:债券	6,136,960,715.21	42.62
2	买入返售金融资产	4,376,589,825.87	30.49
	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	3,811,620,316.36	26.47
4	其他资产	74,103,697.23	0.51
5	合计	14,398,264,548.67	100.00

序号	项目	金额单位:人民币元	
		占基金总资产比例(%)	占基金净资产比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	2.80	-
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券融资余额	1,262,062,221.97	9.63
	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在每个交易日日终前合计占基金资产净值比例均不超过20%;对于货币市场基金,只要其投资的品种(如银行活期存款)可交易,即视为可交易。以上。

## 债券正回购的资金余额超过基金净资产5%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净资产的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开始数	94
报告期内投资组合平均剩余期限结束数	86
报告期内投资组合平均剩余期限期初数	53

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”项目则列示非交易日的数据。

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不得超过120天。本报告期内,本货币市场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

序号	平均剩余期限	各期限段内基金资产净值占基金总资产净值比例(%)	
		基金资产净值比例	基金总资产净值比例
1	30天以内	40.06	96.61
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天(含)-60天	8.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天(含)-90天	14.68	-
	其中:剩余存续期		