

信息披露 Disclosure

上接(B431)版

传真:0451-82287211
 客户服务电话:400-666-2298
 网址:www.jzsc.com.cn
 (78) 爱建证券有限责任公司
 办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
 办公地址:上海市世纪大道1600号32楼
 法定代表人:钱华
 客户服务电话:4001-962-502
 网址:www.jazq.com
 (79) 华宝证券有限责任公司
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
 200120
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
 法定代表人:陈林
 电话:021-50122222
 联系人:楼斯佳
 客户服务电话:400-820-9898
 网址:www.cnhbstock.com
 (80) 中国民族证券有限责任公司
 注册地址:北京市朝阳区东三环中路27号盘古大观A座40层-43层
 办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层-43层
 法定代表人:何亚刚
 客户服务电话:400-889-5618
 网址:www.e6618.com
 (81) 财通证券股份有限公司
 注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
 办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
 法定代表人:沈继宁
 客户服务电话:96336, 40086-96336
 网址:www.ctsec.com
 (82) 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号楼信达金融中心
 法定代表人:张志刚
 联系人:唐静
 联系电话:010-63081000
 传真:010-63080978
 客户服务电话:96321
 网址:www.cindasc.com
 (83) 国融证券股份有限公司(原日信证券有限责任公司)
 注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与吉祥路交汇处武川
 农村村镇银行股份有限公司四楼
 办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心4号楼11层国融证券
 法定代表人:张智河
 联系人:张利军、陈书彬
 联系电话:010-88086830
 客户服务电话:400-660-9839, 96385
 网址:www.grzq.com
 (84) 华龙证券股份有限公司
 注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
 办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
 法定代表人:李殿安
 联系人:李昕田
 电话:0931-4890100
 传真:0931-4890118
 客户服务电话:400-6898888(全国), 96368(甘肃)
 网址:www.hlzqgs.com
 (85) 华福证券有限责任公司
 注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
 办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
 法定代表人:黄金琳
 联系人:张琳
 联系电话:0591-87386323
 业务传真:0591-87386310
 客户服务电话:96326(福建), 400-88-96326(全国)
 网址:www.hfsc.com.cn
 (86) 华融证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街8号
 办公地址:北京市西城区金融大街8号
 法定代表人:韩晓忠
 客户服务电话:96390, 400-898-9999
 网址:www.hrsec.com.cn
 (87) 大通证券股份有限公司
 注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大
 连期货大厦38、39层
 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大
 连期货大厦38、39层
 法定代表人:李红光
 联系人:汪晖
 电话:0411-39673301
 传真:0411-39673219
 客户服务电话:4008-169-169
 网址:www.daton.com.cn, www.estock.com.cn
 (88) 方正证券股份有限公司
 注册地址:长沙芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 办公地址:长沙芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 法定代表人:何志奇
 客户服务电话:96571
 网址:www.foundersc.com
 (89) 中原证券股份有限公司
 注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
 办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
 法定代表人:吕强
 基金业务对外联系人:程月艳 范春艳
 客户服务电话:0371-69098832
 传真:0371-66565899
 客户服务电话:96377
 网址:www.ccnew.com
 (90) 国海证券股份有限公司
 注册地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
 办公地址:广西壮族自区南宁市滨湖路46号
 法定代表人:何春梅
 联系人:武斌
 联系电话:0755-83718808
 传真:0755-83711597
 客户服务电话:965653, 0771-95563
 网址:www.ghzq.com.cn
 (91) 西南证券股份有限公司
 注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
 法定代表人:吴坚
 客户服务电话:4008-096-096, 96355
 网址:www.swsc.com.cn
 (92) 东兴证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
 办公地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)B座12、15层
 法定代表人:魏庆华
 联系电话:010-66556202
 传真:010-66556246
 客户服务电话:400-8888-993
 网址:www.dxzq.net.cn
 (93) 财达证券有限责任公司
 注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号
 办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
 法定代表人:崔建强
 客户服务电话:400-612-8888
 网址:www.c10000.com
 (94) 国金证券股份有限公司
 注册地址:成都市东城根上街95号
 办公地址:成都市东城根上街95号
 法定代表人:冉云
 联系电话:028-8690057, 028-86690058
 传真:028-86690126
 客户服务电话:96310
 网址:www.gjzq.com.cn
 (95) 华西证券股份有限公司
 注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号
 办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
 法定代表人:杨炯洋
 电话:028-86117373
 传真:028-861150615
 客户服务电话:400-8888-818, 96584
 网址:www.hx168.com.cn
 (96) 红塔证券股份有限公司
 注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
 办公地址:上海浦东新区北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
 法定代表人:云南林
 客户服务电话:400-871-8880
 网址:www.hongtazq.com
 (97) 中信证券(山东)有限责任公司
 注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼2001
 办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20
 层
 法定代表人:杨宝林
 客户服务电话:96548
 网址:www.zxwt.com.cn
 (98) 第一创业证券股份有限公司
 注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
 办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
 法定代表人:刘学军
 客户服务电话:96368
 网址:www.firstcapital.com.cn
 (99) 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(b)
 单元
 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦第28层A01、B01
 (b) 单元
 法定代表人:向洋
 客户服务电话:40010-99918(全国) 021-32109999(上海);
 029-68918888(西安)
 网址:www.cisc.com.cn
 (100) 华安证券股份有限公司
 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
 法定代表人:李工
 客户服务电话:96318
 网址:www.hazq.com
 (101) 英大证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦十一、二十八、二十九、
 三十、三十一层
 法定代表人:吴骏
 联系人:吴尔晖
 联系电话:0755-83007159
 客户服务电话:40082-188-688
 网址:www.ydsc.com.cn
 (102) 国盛证券有限责任公司
 注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
 办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
 法定代表人:马跃进
 客户服务电话:4008222211
 网址:www.gsstock.com
 (103) 万联证券有限责任公司
 注册地址:广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层
 办公地址:广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层
 法定代表人:张建军
 客户服务电话:400-8888-133
 网址:www.wljz.com.cn
 (104) 大同证券有限责任公司
 注册地址:山西省大同市迎宾街15 号桐城中央21层
 办公地址:山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A 座
 12、13 层
 法定代表人:董祥
 客户服务电话:4007121212
 网址:www.dtsbc.com.cn
 (105) 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:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
 法定代表人:郭林
 联系人:李颖
 联系电话:021-38774818-9508
 客户服务电话:4008-820-5999
 网址:www.shhxzq.com
 (106) 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 楼 10 层 1006F
 办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 楼 10 层 1006F
 法定代表人:张蕊
 联系人:魏静
 联系电话:010-63081000
 传真:010-63080978
 客户服务电话:96321
 网址:www.cindasc.com
 (83) 国融证券股份有限公司(原日信证券有限责任公司)
 注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道与吉祥路交汇
 处武川
 农村村镇银行股份有限公司四楼
 办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心4号楼11层国融证券
 法定代表人:张智河
 联系人:张利军、陈书彬
 联系电话:010-88086830
 客户服务电话:400-660-9839, 96385
 网址:www.grzq.com
 (84) 华龙证券股份有限公司
 注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
 办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
 法定代表人:李殿安
 联系人:李昕田
 电话:0931-4890100
 传真:0931-4890118
 客户服务电话:400-6898888(全国), 96368(甘肃)
 网址:www.hlzqgs.com
 (85) 华福证券有限责任公司
 注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
 办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
 法定代表人:黄金琳
 联系人:张琳
 联系电话:0591-87386323
 业务传真:0591-87386310
 客户服务电话:96326(福建), 400-88-96326(全国)
 网址:www.hfsc.com.cn
 (86) 华融证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街8号
 办公地址:北京市西城区金融大街8号
 法定代表人:韩晓忠
 客户服务电话:96390, 400-898-9999
 网址:www.hrsec.com.cn
 (87) 大通证券股份有限公司
 注册地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大
 连期货大厦38、39层
 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座—大
 连期货大厦38、39层
 法定代表人:李红光
 联系人:汪晖
 电话:0411-39673301
 传真:0411-39673219
 客户服务电话:4008-169-169
 网址:www.daton.com.cn, www.estock.com.cn
 (88) 方正证券股份有限公司
 注册地址:长沙芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 办公地址:长沙芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
 法定代表人:何志奇
 客户服务电话:96571
 网址:www.foundersc.com
 (89) 中原证券股份有限公司
 注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
 办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
 法定代表人:吕强
 基金业务对外联系人:程月艳 范春艳
 客户服务电话:0371-69098832
 传真:0371-66565899
 客户服务电话:96377
 网址:www.ccnew.com
 (90) 国海证券股份有限公司
 注册地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
 办公地址:广西壮族自区南宁市滨湖路46号
 法定代表人:何春梅
 联系人:武斌
 联系电话:0755-83718808
 传真:0755-83711597
 客户服务电话:965653, 0771-95563
 网址:www.ghzq.com.cn
 (91) 西南证券股份有限公司
 注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
 办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
 法定代表人:吴坚
 客户服务电话:4008-096-096, 96355
 网址:www.swsc.com.cn
 (92) 东兴证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
 办公地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)B座12、15层
 法定代表人:魏庆华
 联系电话:010-66556202
 传真:010-66556246
 客户服务电话:400-8888-993
 网址:www.dxzq.net.cn
 (93) 财达证券有限责任公司
 注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号
 办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
 法定代表人:崔建强
 客户服务电话:400-612-8888
 网址:www.c10000.com
 (94) 国金证券股份有限公司
 注册地址:成都市东城根上街95号
 办公地址:成都市东城根上街95号
 法定代表人:冉云
 联系电话:028-8690057, 028-86690058
 传真:028-86690126
 客户服务电话:96310
 网址:www.gjzq.com.cn
 (95) 华西证券股份有限公司
 注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号
 办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
 法定代表人:杨炯洋
 电话:028-86117373
 传真:028-861150615
 客户服务电话:400-8888-818, 96584
 网址:www.hx168.com.cn
 (96) 红塔证券股份有限公司
 注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
 办公地址:上海浦东新区北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
 法定代表人:云南林
 客户服务电话:400-871-8880
 网址:www.hongtazq.com
 (97) 中信证券(山东)有限责任公司
 注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼2001
 办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20
 层
 法定代表人:杨宝林
 客户服务电话:96548
 网址:www.zxwt.com.cn
 (98) 第一创业证券股份有限公司
 注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
 办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
 法定代表人:刘学军
 客户服务电话:96368
 网址:www.firstcapital.com.cn
 (99) 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(b)
 单元
 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦第28层A01、B01
 (b) 单元
 法定代表人:向洋
 客户服务电话:40010-99918(全国) 021-32109999(上海);
 029-68918888(西安)
 网址:www.cisc.com.cn
 (100) 华安证券股份有限公司
 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
 法定代表人:李工
 客户服务电话:96318
 网址:www.hazq.com
 (101) 英大证券有限责任公司
 注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

公司网站: www.noah-fund.com
 (127) 上海诺亚资产管理
 注册地址: 上海自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 办公地址: 上海自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
 法定代表人: 魏巍
 客服电话: 4008219031
 公司网站: www.lufunds.com
 (128) 嘉实财富管理有限公司
 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
 办公
 楼二三层35312-15单元
 办公地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期
 50层
 53层12-15单元
 法定代表人: 赵学军
 客服电话: 400-021-8850
 公司网站: www.harvestwm.cn
 (129) 北京唐鼎耀华投资管理有限公司
 注册地址: 北京市朝阳区延庆路40号二号楼236室
 办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路42号二十一世纪大厦A座303室
 法定代表人: 张冠宇
 客服电话: 400-819-9869
 公司网站: www.dtyhfund.com
 (130) 上海凯石财富基金销售有限公司
 注册地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
 办公地址: 上海市黄浦区西藏南路765号凯石大厦4楼
 法定代表人: 陈维武
 联系人: 李晓明
 联系电话: 021-63333319
 客户服务电话: 4000178000
 网址: www.vwotks.com.cn
 (131) 泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
 注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海公园龙园3号
 办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海公园龙园3号
 法定代表人: 林森
 客服电话: 4006-411-999
 公司网站: www.haoliyou.com
 (132) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
 注册地址: 厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504室
 办公地址: 厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
 法定代表人: 张洪生
 联系电话: 0592-3128888, 0592-8060888
 客服电话: 400-818-0808
 公司网站: www.xds.com.cn
 (133) 北京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: 北京市海淀区中关村e世界A座1108室
 法定代表人: 王伟刚
 客服电话: 400-62680627
 客户服务电话: 400-619-9069
 公司网站: www.fundzone.cn 或 www.51jinhui.com
 (134) 珠海盈米财富管理有限公司
 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号106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
 联系人: 钟琛
 联系电话: 020-89629012
 客户服务电话: 020-89629066
 公司网站: www.yingmi.com
 (135) 上海联泰资产管理有限公司
 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: 上海市长宁区福泉北路518号8层3室
 法人代表: 燕斌
 联系人: 陈东
 客户服务电话: 4000-466-788
 公司网站: www.66zichan.com
 (136) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
 注册地址: 北京市丰台区右安门外大街2号2-45室
 办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
 法定代表人: 钱慧英
 客户服务电话: 4008-909-998
 公司网站: www.jlnc.com
 (137) 奕丰金融服务(深圳)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
 前海商秘书有限公司)
 办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1116室及1307室
 法定代表人: T'AN YIK KUAN
 联系人: 叶建
 联系电话: 0755-89460500
 客户服务电话: 400-684-0500
 网址: www.ifastps.com.cn
 (138) 乾道金融信息服务(北京)有限公司
 注册地址: 北京市西城区德胜门内大街13号院1号楼1302
 办公地址: 北京市西城区德胜门内大街13号院1号楼1302室
 法人代表: 王兴吉
 客户服务电话: 400-088-8080
 网址: www.qiandaojr.com
 (139) 北京乾道广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
 法人代表: 李悦章
 联系人: 曹庆章
 联系电话: 010-65983311
 客户服务电话: 400-066-8586
 网址: www.qiandao.com.cn
 (140) 北京广盈达投资管理有限公司
 注册地址: 北京市西城区德胜门内大街28号C座六层906室
 办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区涌项中心B座19层
 法定代表人: 齐剑峰
 联系人: 王永霞
 联系电话: 15201586214
 客户服务电话: 4006236060
 网址: www.niuniuni.com
 (141) 北京新浪乐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5层15室
 办公地址: 北京市海淀区西北旺东路10号院西区9号楼新浪总部大
 厦
 法定代表人: 李昭琛
 联系人: 付文红
 电话: 010-62757369
 传真: 010-62765822
 客户服务电话: 010-62675369
 网址: www.xincai.com
 (142) 泰信财富投资管理有限公司
 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: 北京市朝阳区西四环北路69号一层
 法定代表人: 李静
 联系人: 周楠
 电话: 010-88499161-8006
 传真: 010-88460066
 客户服务电话: 400-1687675
 网址: www.taixincf.com
 (143) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司
 注册地址: 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
 办公地址: 北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园 凤凰金
 融18号
 楼
 法定代表人: 程刚
 客户服务电话: 400-8105-919
 网址: www.fengfd.com
 (144) 上海万得投资管理
 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号1楼B座
 办公地址: 上海市浦东新区福山路33号8楼
 法定代表人: 王廷富
 联系人: 徐亚丹
 联系电话: 13818306630
 客户服务电话: 400-821-0203
 (145) 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第一大街79号MSDC1-28层2801
 办公地址: 北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
 法定代表人: 丁东华
 客户服务电话: 400-111-0889
 网址: www.gomefund.com
 (146) 北京爱盈基金销售有限公司
 注册地址: 北京市朝阳区呼家楼京广中心1号楼36层3603室
 办公地址: 北京市朝阳区福乐时光中心B座8号富华大厦F座12层E区
 法定代表人: 程刚
 客户服务电话: 400-100-3381
 网站: www.dianyingfund.com
 基金管理人可提前按法律法规的要求,选择其他符合要求的机构
 代理销售基金,并及时公告。
 (三) 注册与过户登记人
 名称: 诺安基金管理有限公司
 注册地址: 深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层
 法定代表人: 秦伟非
 电话: 0755-83026687
 传真: 0755-83026677
 (四) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师
 名称: 北京市中伦金通律师事务所深圳分所
 住所: 深圳市福田区深南东路5047号深圳发展银行大厦17楼D
 负责人: 胡智辉
 电话: 0755-25870908
 传真: 0755-25847000
 (五) 审计机构名称: 中审会计师事务所和经办注册会计师
 名称: 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
 住所: 上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
 执行事务合伙人: 卢伯珉
 联系电话: 021-6141 8888
 联系人: 余志坚
 传真: 021-6335 0003
 法定注册会计师: 王明静、吴迪
 一、基金名称
 诺安货币市场基金
 二、基金类型
 契约型开放式

三、基金的投资目标
 确保本金的安全性和资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基
 准的稳定收益。
 四、基金的投资方向
 本基金的投资标的物包括但不限于以下金融工具: 剩余期限在397
 天以内(含397天)的国债、金融债和AAA企业债等债券,期限在一年以
 内(含一年)的债券回购、中央银行票据和银行存款(含现金、银行定期
 存款、大额存单等)以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好
 流动性的金融工具。
 五、基金的投资策略
 根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况,判断
 短期利率的走势,进行自上而下的整体资产配置和资产组合配置;
 同时,根据定量和定性方法,在个别回购品种、债券品种和市场时机方面
 进行主动式选择。
 根据公司自有的现金流管理模型和持有人平均持有期限分析,对组
 合中各金融产品的流动性、风险性和收益性特征进行动态配置(本基金
 资产配置的目标是在充分满足流动性的基础上获得稳定的投资收益)。
 因此,本基金的整体资产配置部分,主要包括市场利率预期、基金组
 合平均剩余期限等由投资决策委员会主要根据市场利率情况及未来资金
 来判断决定的事项。本基金的投资组合配置和个券选择部分,主要包
 括市场和债券品种选择、关键时期的时机选择、回购套利、选择价格较
 低劣的央行票据和短期债券投资等由投资决策委员会根据当时市场情况、市场
 环境变化等,充分利用公司研究资源和金融工程技术调整资产配置比
 例,以期达到优化配置效果。
 1、 决策依据
 (1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是
 本基金进行投资的前提;
 (2) 宏观经济政策态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是
 本基金投资决策的基础。
 2、 决策程序
 (1) 投资决策委员会定期召开会议,决定基金的主要投资原则,并
 对基金投资组合的资产配置比例等作出决定。
 (2) 研究部门对债券市场的债券或票据进行评级和定价,对宏观经
 济主要是利率预期等进行分析,提出分析报告。基金事务部提供基金申
 购、赎回的数据,供基金经理参考。
 (3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究部提出的报
 告和依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定资产
 配置、个债配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。
 (4) 中央交易室依据基金经理的指令,制定交易策略并执行交易。
 (5) 监察稽核部负责核查基金经理的操作是否符合基金合同和有关基
 金投资的法律、法规;运用风险监控模型进行各风险风险监控,对市场
 预期风险和进行风险控制,负责对基金组合的风险进行评估,提交风险
 监控报告,风险控制委员会定期召开会议,负责监督基金管理组投资方
 案的执行情况,评估风险监控报告,并进行投资风险预警。
 3、 投资操作流程图
 (1) 构造组合:分三个层次
 1) 组合整体久期研判:结合宏观经济分析,预测利率走势,确定短期
 债券类资产与现金资产的比例;
 2) 资产组合配置:通过收益率-方差模型确定;
 3) 个券选择:充分考虑流动性和组合整体久期风险,挑选价值相对
 被低估债券,利用利率期限结构模型进行价值评估;
 (2) 资产配置流程
 1) 研究部固定收益研究人员完成短期资金市场分析报告和资产策
 略配置测算;
 2) 基金经理每季度制定资产配置计划(包括短期债券类资产、现金
 资产配置比例、资产组合配置比例);
 3) 投资决策委员会审议资产配置计划;
 4) 基金经理执行审定后的资产配置计划,并根据限制条件实施跟
 踪、调整。
 (3) 交易流程
 1) 基金经理以电脑或书面形式向中央交易室下达交易指令;
 2) 中央交易室主管根据交易员拟定交易计划;
 3) 交易员准确及时执行;
 4) 监察稽核部监督交易员完成交易计划;
 5) 中央交易室及时反馈市场信息,保持与基金经理的有效沟通;
 (4) 投资监督和风控
 1) 风控措施保证投资目标实现和投资限制执行;
 2) 风险控制委员会成员、投资总监、交易主管和监察稽核人员实施
 监督;
 3) 必要时启动“刹车”机制;
 4) 交易主管有权修正交易员的交易行为;
 (5) 数量分析系统
 北方之星开发的Alpha债券分析系统;交易所、银行间个券的利率期
 限结构定价、个券特征分析和个券之间的比较分析、债券投资组合分析;
 系统的开发者和维护者一直与基金管理人、债券研究和投资人
 人员保持密切的技术沟通和交流,以使模型不断完善和确保数据的准确性和
 及时性;
 (6) 组合调整
 1) 短期债券和现金比例调整:结合宏观经济指标是否发生变化
 市场对利率的预期是否发生变化
 短期债券组合是否符合久期限制条件
 2) 资产组合配置比例调整
 资产组合比例是否符合投资限制条件
 3) 个债调整
 个债投资流动性如何
 个债投资比例是否符合投资限制条件
 六、基金的业绩比较基准
 以当期银行一年定期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的
 比较基准。
 七、基金的风险收益特征
 本基金属流动性高,风险低并且收益稳定。
 八、基金投资组合报告
 本投资组合报告所载数据截止日为2016年9月30日,本报告中所列
 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)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,372,033,037.00	35.29
	其中:国债	4,372,033,037.00	35.29
2	货币市场基金	-	-
3	买入返售金融资产	1,569,262,204.97	12.67
	其中:买入返售金融资产-质押式回购	-	-
4	银行存款和结算备付金合计	6,276,462,898.24	51.46
5	其他资产	71,248,201.69	0.58
6	合计	12,389,564,202.97	100.00

2. 报告期末债券回购融资情况			
序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期末债券回购融资余额		2.44
	其中:买入返售金融资产		
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,376,466,735.31	12.51
	其中:买入返售金融资产		

注:本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末交易日融资余额占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的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的。

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,376,466,735.31	12.51
	其中:买入返售金融资产	-	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,376,466,735.31	12.51
	其中:买入返售金融资产	-	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,376,466,735.31	12.51
	其中:买入返售金融资产	-	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,376,466,735.31	12.51
	其中:买入返售金融资产	-	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1,376,466,735.31	12.51
	其中:买入返售金融资产	-	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
----	----	----	--------------