

信息披露 Disclosure

(上接B173版)

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
公司地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
法定代表人:马令海
订购热线:4009-945-899
新闻中心:0755-88390499
传真号码:0755-88394677
新兰德网站:http://www.new-rand.cn/
86)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王利
客服电话:4008-773-772
联系人:周旋
电话:021-20836789
传真:021-20836835
网址:www.5ifund.com
87) 厦门市鑫鼎隆证券投资咨询有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
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:林松
联系人:高雷
电话:0592-3122719
传真:0592-8060771
客户服务电话:4009-180-808
网址:www.xsdsl.com.cn
88) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市金山区枫泾镇工业园区650号205室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
电话:021-38800735
电 话:021-38800777
89) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元
法定代表人:薛峰
电话:021-54909988
传 真:021-64385308
91) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区南汇新城镇芦潮港国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
电 话:021-58870011
传 真:021-68596919
公司网站:http://www.howbuy.com/
92) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:张裕
电话:021-60897840
传真:0571-26895863
客服电话:4000-766-123
网址:http://www.fund123.cn/
93) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢2202室
法定代表人:张跃伟
联系人:冉丹雄
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客服电话:400-089-1289
公司网站:www.richfund.com
94) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
邮 编:311012
联系人:胡璇
联系电话:0571-88911818
传 真:0571-88800423
客服电话:4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com
95) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京乡望花楼富安大厦6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外大街北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
电话:010-62020088
传 真:010-62020088-8002
96) 上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
法定代表人:盛大
电话:021-50683532-3006
传真:021-50683933
客服电话:400-005-6355
网站:www.leadfund.com.cn
97) 中期时代基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路晓
电话:010-65807865
传真:010-65807868
客服电话:95162 4008888160
网站:www.citicifund.com
98) 乾道金融信息服务(北京)有限公司
名称:乾道金融信息服务(北京)有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人:王兴吉
电话:010-62062880
传真:010-82057741
99) 泛华普益基金销售有限公司
注册地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海峰
电话:028-82000966
传真:028-82000996-805
客服电话:4008-588-588
网站: http://www.pyfund.com/
100) 贤信普泽投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
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:沈伟祥
公司网站:www.yxinfund.com
服务热线:400-6099-200
客服邮箱:service@yxinfund.com
101) 南京苏宁基金销售有限公司
名 称: 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
邮政编码:210042
注册资本: 2000万元人民币
法定代表人: 钱燕飞
电 话:025-66966999-887226
传 真:025-66966999
联系人:王峰
102) 北京路上理财富闻有限公司
北京路上理财富闻有限公司
客服电话:400-080-5828
网站:www.lifund.com
103) 众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东四环中路27号楼5号3201单元3201单元
办公地址:北京市朝阳区东四环中路27号楼5号3201单元3201单元
电话:010-59393232
传真:010-59393074
客服电话:400-876-9988
网站:www.wy-fund.com
104) 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号建威大厦1202室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
电话:010-67000988
传真:010-67000988-6000
联系人:孙晋峰
网站:www.zcwcc.com.cn 客户服务电话:400-001-8811
105) 北京恒天明泽基金销售有限公司
名 称: 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
电话:4008-980-618
传真:010-56810628
106) 深圳宜投基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号深港合作区管理局综合办公
楼A座201
办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人:华建强
电话:0755-88607645
名 称: 北京展恒天下一投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万安大厦D座21、26层
邮政编码:100020
注册资本: 1亿元人民币
法定代表人: 孙晓峰
电 话:010-58170708
传 真:010-58170710
108) 一路财富(北京)信息科技有限公司
名 称: 一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区广安门内大街2号万通新世界广场A座2208
邮政编码:100033
注册资本: 5000万元人民币
法定代表人: 吴昊霄
电 话:010-88312277
传 真:010-88312099
109) 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1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:魏新
电话:010-57418829
传真:010-57696771
网站:www.qianjing.com
“客户服务电话:4008038885
110) 海银基金销售有限公司
名称“海银基金销售有限公司”
简称“海银基金”
网站:www.fundhaiyin.com
客服电话:400-906-1016
111) 北京广源达信投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区新街口外大街28号C座六层805室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
邮政编码:100102
电 话:4006230060
传 真:010-82065860
112) 天津国美基金销售有限公司
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号鹏南大厦B座19层
邮政编码:100016
注册资本:人民币2000万元
法定代表人:丁东华
电 话:010-59287061
传 真:010-59287825

113) 北京新鑫合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906室
办公地址:北京市海淀区海淀北二街10号泰富大厦12层
邮政编码:100080
电 话:010-62675369
传 真:010-82607151
114) 中银证券(北京)资产管理有限公司
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:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人:徐福星
电话:010-68989820-8188
传真:010-68818150
115) 北京君恒汇富投资咨询有限公司
北京君恒汇富投资咨询有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址:北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人:李振
电话:65181028
传真:65174782
116) 佳弘(北京)基金销售有限公司
佳弘(北京)基金销售有限公司
客服电话:4006-525-676
网站:www.jiahongfund.com
117) 上海万得投资顾问有限公司
名 称: 上海万得投资顾问有限公司
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:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号8楼
邮政编码:200120
注册资本: 2千万元人民币
法定代表人:王廷富
电 话:021-5132 7185
传 真:021-5071 0161
118) 凤凰金信(银川)投资管理有限公司
销售机构名称:凤凰金信(银川)投资管理有限公司
销售机构简称:凤凰金信
客服电话:400-800-5919
网站:www.fengd.com
119) 上海聚泰资产管理有限公司
名 称: 上海聚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:上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
邮政编码:200335
注册资本:2,000万人民币
法定代表人:秦斌
电 话:021-51507071
传 真:021-62990063
120) 泰诚财富基金销售有限公司
注册地址:北京市丰台区东大街1号1楼16层1603
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
邮政编码:100022
注册资本: 2000万元人民币
法定代表人: 董顺
电 话:010-56400010
121) 上海凯石财富基金销售有限公司
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:上海市黄浦区延安路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈健武
电话:021-63333889
传真:021-63333390
122) 中正达广股份有限公司
公司名称:中正达广股份有限公司
公司地址:上海徐汇区龙腾大道2815号30
客服电话:400-6767-523
邮箱:zwwalth@zwwalth.cn
123) 北京展融多源投资咨询有限公司
名 称: 北京展融多源投资咨询有限公司
注册地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
办公地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
邮政编码:100022
注册资本: 2000万元人民币
法定代表人: 董顺
电 话:010-56400010
124) 深圳前海财信管理有限公司
公司名称: 深圳前海财信管理有限公司
英文名称: Shenzhen Fuji
办公地址: 深圳市福田区科苑南路高新南七路惠康大厦二期418室
公司注册地址: 深圳市福田区深港合作区前海一路1号A栋201室
邮政编码:518000
注册资本: 2000.0万元
公司网站: www.jinqianwo.cn
服务热线: 0755-83939907
客服电话: 0755-83939926
客服邮箱: fujiwealth@163.com
125) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址: 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14楼
法定代表人: 郭皓
组织形式: 有限责任公司
存续期间: 持续经营
联系人: 宁博宇
电 话: 021-20665952
传 真: 021-22099953
126) 大泰金石投资管理有限公司
大泰金石投资管理有限公司
客服电话:4009282266
网站: www.dttfund.com
127) 珠海盈米财富管理有限公司
名 称: 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1201-1203
邮政编码:510308
注册资本:2432.4311万元人民币
法定代表人: 肖雯
电 话:020-89629021
传 真:020-89629011
128) 和耕传承基金销售有限公司
机构名称:和耕传承基金销售有限公司
客服电话:4000-655-671
网站:http://www.hgcpb.com
129) 类丰金融服务(深圳)有限公司
名 称: 类丰金融服务(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(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室
邮政编码:518054
注册资本:2000万元人民币
法定代表人:TAN YIK KUAN
电 话:0755-89408000
传 真:0755-21674453
130) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
名 称: 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址: 北京市丰台区东管头1号2号楼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
邮政编码:100052
注册资本: 4475.1万元
法定代表人:彭运华
电 话:010-5938533
传 真:010-59385900
131) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司
名 称: 北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
注册资本: 2000万元
法定代表人: 陈超
电 话: 4000888511/ 4000888816
传 真: 010-89188000
132) 中民财富管理(上海)有限公司
名 称: 中民财富管理(上海)有限公司
注册地址: 上海市黄浦区中山南路101号7层
办公地址: 上海市黄浦区中山南路100号17层
邮政编码:200010
注册资本: 1亿元人民币
法定代表人: 周洪军
电 话:021-33365333
传 真:021-33365288
133) 上海云湾投资管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼4层
办公地址: 上海市锦康路308号6号楼6楼
电话:021-20638888
传真:021-20639990
134) 北京微众基金销售有限公司
北京微众基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区望京东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址: 北京市朝阳区望京东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人: 钟思曼
电话:010-61840688
135) 中信建投期货有限公司
注册地址: 渝中区中山三路107号上站大楼平层11-B,名义层11-A-B、84-9-B、C
办公地址: 渝中区中山三路107号上站大楼平层11-B,名义层11-A-B、84-9-B、C
邮编: 400014
电话:023-66769605
网站: www.cfc108.com
136) 中信期货有限公司
中信期货有限公司
客服电话:400-990-8826
网站: www.citicf.com
137) 徽商银行股份有限公司
徽商银行股份有限公司
客服电话:4008878707
网站: www.hsb.cn
138) 东证期货股份有限公司
公司名称: 东证期货股份有限公司
成立时间: 1995年12月8日
所在地: 中国上海
注册资本: 10000.00万人民币
法定代表人: 卢大印
企业类型: 一人有限责任公司(法人独资)
组织机构代码: 132110914
经营范围: 商品期货经纪,金融期货经纪,期货投资咨询,资产管理,基金销售
139) 弘业期货股份有限公司
注册地址: 南京市栖霞区迈皋桥32号弘业大厦9楼
法定代表人: 周剑秋
客户服务电话: 400-828-1288
客服电话: 4008281288@tolo.com.cn
网站: http://www.tolo.com.cn

本公司将依据实际情况变更销售机构并予以公告,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代理销售基金,并及吋公告。

(三) 登记机构
1. 北添富基金销售有限公司
住所: 上海市黄浦区区大马路288号6幢538室
办公地址: 上海市浦东新区樱花路968号建工大唐国际广场A座7楼
法定代表人: 李文
电话: 021-28932871
传真: 021-28932876
联系人: 杨利慧
2. 中国证券登记结算有限责任公司
住所: 北京市西城区太平桥大街17号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人: 周明
电话: (010) 59378962
传真: (010) 59378907
联系人: 陈爽

(四) 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
住所: 上海市浦东新区银城中路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: 俞卫锋
电话: (021) 31358666
传真: (021) 31358600
经办律师: 黎明、孙睿
联系人: 陈颖华
(五) 审计基金财产的会计师事务所
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
首席合伙人: 吴港生
住所: 北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼16层1601室
办公地址: 北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼16层1601室
邮政编码: 100738
公司电话: (010) 58151500
公司传真: (010) 58158298
签字注册会计师: 陈霖、陈晖
业务负责人: 陈霖、陈晖

第四部分 基金的名称
第五部分 基金的类型
本基金为契约型开放式货币市场基金

第六部分 基金的投资目标
在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 基金的投资方向
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、通知存款、短期融资券、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略
本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益。

1、本基金的投资策略将基于以下研究分析:
(1) 宏观经济趋势
A. 宏观经济趋势是央行制定货币政策的基础,也是影响经济总体货币需求的关键因素,因此宏观经济趋势基本确定了未来较长时期内的利率水平。在分析宏观经济趋势时,本基金重点关注两个因素:一是经济成长前景;二是通货膨胀率及其预期。

B. 央行货币政策
包括准备金存、贷款利率,法定存款准备金率,公开市场操作的方向、力度,以及央行的窗口指导等。央行的货币政策取向是影响货币市场利率的最直接因素。在央行紧缩货币、提高基准利率时,市场利率一般会相应上升;而央行放松货币、降低基准利率时,市场利率则相应下降。

C. 商业银行的信贷扩张
商业银行的信贷扩张是央行实现其货币政策的重要途径,也是经济总体货币需求的体现。因此商业银行的信贷扩张对货币市场利率具有举足轻重的影响。一般来说,商业银行信贷扩张越快,表明经济总体的货币需求越旺盛,货币市场利率也越高;反之,信贷扩张越慢,货币市场利率则越低。

D. 国际资本流动
中国日益成为一个开放的国家,国际资本进出也更加频繁,并导致央行被动的投放或收回国际资本,造成货币市场利率的波动。在人民币汇率制度已经从盯住美元转为以市场供求为基准、参考一篮子货币进行调节、有管理的浮动汇率制度的情况下,国际资本流动对国内市场利率的影响也越来越重要。

2、其他影响短期货币资金供求关系的主要因素
包括财政存款的短期变化,市场季节性、突发性的资金需求等。

(2) 市场结构研究
银行间市场与交易所市场在资金供给者和需求者结构上均存在差异,利率水平因此有所不同。不同类型市场工具由于存在税负、流动性、信用风险上的差异,其收益率水平也略有不同。资金供给者、需求者结构的差异化引起利率水平的变化。利率水平与收益率差异,利率变化将影响并保证流动性、安全性的基础上为基金资产带来更高的收益。

(3) 企业信用研究
直接融资的发展是一个长期趋势,企业债、企业短期融资券因此也将成为货币市场基金重要的投资对象。为了保障基金资产的安全,本基金将按照相关法规投资于具有满足信用等级要求的企业短期融资券。与此同时,本基金还将深入分析发行人的财务稳健性,判断发行人违约的可能性,严格控制企业债券、短期融资券的违约风险。

2、本基金基金投资策略
(1) 滚动配置策略
本基金将根据具体投资品种的市场特性采用持续投资的方法,既能提高基金资产变现能力的稳定性,又能保证基金资产收益与市场利率的基本一致。

(2) 久期策略
本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或取得较高的收益率。

(3) 套利策略
套利策略包括跨市场套利和跨品种套利。跨市场套利是利用同一金融工具在各个子市场的不同表现进行套利。跨品种套利是利用不同金融工具的收益率差别,在满足基金自身流动性、安全性需要的基础上,寻求更高的收益。

(4) 杠杆选择策略
股票、债券发行以及年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,从而推高货币市场利率。利用这种失衡,就能提高基金资产的收益率。

本基金将在宏观分析和基本分析的基础上,对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,并在控制风险的前提下尽可能地提高本基金收益。

3、资产支持证券投资策略
本基金将采取久期配置策略与期限结构配置策略相结合。本基金运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析,对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析 and 量度, 筛选风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

第九部分 基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则相应的业绩比较基准也将随之调整,本基金将视市场利率和基金资产收益情况,在充分听取基金份额持有人意见的前提下,按照法律法规的规定履行相应程序后,对业绩比较基准进行调整,以更科学、更合理地反映基金资产收益。

如果今后市场中出现更具有代表性的业绩比较基准,或者有更科学的业绩比较基准,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,经与基金托管人协商一致后,变更本基金的业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征
本基金为货币市场基金,基金投资风险基金资产的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

第十一部分 基金的投资组合报告
基金管理人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。

基金管理人承诺本报告按照法律法规要求编制,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。

于2017年4月20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。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

投资组合报告

1.1 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 5,871,157,006.01 48.10

其中:债券 5,871,157,006.01 48.10

2 买入返售金融资产 366,617,349.92 3.00

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 5,814,632,306.16 47.64

4 其他资产 153,966,088.25 1.26

5 合计 12,206,372,750.94 100.00

1.2 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 报告期内债券回购融资余额 4.31

其中:买断式回购融资 - -

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

2 报告期末债券回购融资余额 - -

其中:买断式回购融资 - -

注:报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期内每交易日报融资余额占资产净值的比例存在差异,差异原因如下:
1.2 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
注: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资产净值的20%。

1.3 基金投资组合平均剩余期限
1.4.1 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 77

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 84

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 50

1.4.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
注:本基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期未发生该情况。

1.4.3 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 各期限资产占基金资产净值的比例(%) 各期限负债占基金资产净值的比例(%)

1 30天以内 26.44 - -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债 - -

2 30天<=90天 20.90 - -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债 - -

3 90天<=180天 23.28 - -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债 5.17 - -

4 180天<=270天 8.27 - -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债 1.63 - -

5 270天<=397天(含) 19.91 - -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率负债 - -

合计 98.80 - -

1.5 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明
注:本基金合同约定“本基金投资组合平均剩余期限未超过240天”,本报告期未发生该情况。

1.6 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 央行票据 - -

3 金融债券 2,156,225,296.28 17.68

其中:政策性金融债 2,156,225,296.28 17.68

4 企业债券 - -

5 企业短期融资券 2,626,083,962.47 21.53

6 中期票据 - -

7 同业存单 1,088,847,747.26 8.93

8 其他 - -

9 合计 5,871,157,006.01 48.13

10 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 828,635,060.45 6.80

1.7 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120223 12国债33 9,600,000 969,847,791.31 7.87

2 130242 13国债42 4,300,000 430,517,575.62 3.53

3 111610329 16 兴 业 CD329 4,000,000 399,732,931.66 3.28

4 130216 13国债16 3,500,000 347,748,208.54 2.85

5 011638885 16 联 通 SC206 3,200,000 319,883,780.52 2.62

6 011638725 16 国 电 SC206 3,000,000 299,461,337.72 2.46

7 011638824 16 联 通 SC205 2,400,000 239,769,210.51 1.97

8 011