

# B102信息披露

# Disclosure

## 嘉合货币市场基金2017年第三季度报告

本报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年第三季度,八、九月份宏观经济数据有所下滑,央行仍旧维持稳健中性的货币政策,公开市场精准投放,消峰填谷,维持资金平衡。然而由于超储率持续处于低位,降准、缴税等因素对资金面造成负面影响加剧。

三季度债券市场呈现震荡小幅上行态势,收益率曲线转平。六月监管放缓并增强协调性,七月资金面有所缓和,债券收益率在七月阶段性见底。八月流动性陡然收紧,债券收益率随之明显上行。进入九月,资金压力有所缓解,存单利率大幅下降,债券收益率小幅震荡下行。

本基金报告期内保持组合中低性平均剩余期限,增配关键期限到期的存单和债券,增强组合的变现能力。随着资金面改善,积极把握同业存单配置机会,加大杠杆并适当拉长久期。随着十月《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的实施,我们将进一步加强风险管理,坚持规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类基金份额净值收益率为1.0723%,同期业绩比较基准收益率为3.0403%;B类基金份额净值收益率为1.1334%,同期业绩比较基准收益率为3.0403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内无需要说明的相关情形。

5.1 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 固定收益类 10,201,742,260.63 90.09

其中:债券 10,201,742,260.63 90.09

资产支持证券 -- --

2 买入返售金融资产 529,216,794.33 3.21

其中:买入返售金融资产的买入金额或融资余 529,216,794.33 3.21

3 银行存款和结算备付金合计 716,849,846.62 4.34

4 其他资产 69,773,126.43 0.36

5 合计 16,597,565,032.01 100.00

5.2 报告期末债券投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 按品种分类的债券投资组合 177,446,134.71 11.31

其中:国债 177,446,134.71 11.31

2 报告期末持有的资产支持证券 1,644,328,193.52 11.07

其中:资产支持证券 1,644,328,193.52 11.07

注:报告期内债券投资组合资产配置比例中债券占比为报告期内每日债券资产净值占资产净值的比例。

5.3.1 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最高值 26

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限

5.3.1 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最高值 106

报告期末投资组合平均剩余期限最低值 26

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天资产情况 29

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过120天资产情况

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

本报告期末,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%。

5.3 投资组合平均剩余期限</