

B010 信息披露 | Disclosure

(上接B009版)
基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际情况需要对上述投资决策程序作出调整。
(2)交易
基金管理人根据投资组合方案制订相关的投资指令。下达给集中交易室执行，基金经理必须遵守交易下单权和交易执行严格分离的规定。集中交易室依据基金的管理指令，统一执行投资组合计划，进行具体品种的交易，将执行结果反馈给基金经理确认。交易指令执行结束后，交易员填写交易回执，经基金经理确认后交给相关客户服务部。

(3)清算交收
本基金的清算交收、基金会计核算和报表、基金的交易记录和保管由基金运作部负责部门。清算交收是指基金经办的交易指令、交易员的交易回执后，与交易所的对账进行核对。如果发现不同的记录将由交易员和客户服务单位进行核查，在当日及时处理完毕。得到确认无误的交易单据和交易回执后再归档备案。
九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款利率(税后)。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场发展状况对基金的资产配置和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的调整应经基金管理人和基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并及时予以公告。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基本基金。在一般情况下，其风险与预期收益低于一般债券型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承诺对基金的准确性、完整性承担责任及个别及连带责任。

基金管理人在此郑重声明：本基金在银行间债券市场进行投资，将严格遵守《全国银行间债券市场债券交易管理办法》。

本基金组合报告由基金管理人编制并披露于本基金2019年第4季度报告，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。

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 活期存款和结算备付金 840,869,390 72.01

2 国债 29,840,769,39 72.01

3 债券回购 - -

4 其他资产 10,998,13650 19.88

其中：应收申购款余额 - -

5 贷款和应收款项 56,330,46300 100.00

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国债 - -

2 其他国债 - -

3 金融债券 9,906,13368 18.22

其中：政策性金融债 9,906,13368 18.22

4 企业债券 - -

5 金融债 - -

6 中期票据 29,444,63671 54.40

7 同业存单 - -

8 其他 - -

9 合计 39,440,769,39 72.02

10 其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券 - -

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名货币市场基金

序号 项目 占基金资产净值的比例 (%)

1 报告期末持有的货币市场基金余额 0.13

其中：定期式理财产品 - -

2 报告期末持有的货币市场基金余额 - -

其中：定期式理财产品 - -

注：报告期内货币市场基金余额超过基金资产净值的简单平均值。

货币正回购的余额不超过基金资产净值的20%的说明

在报告本期内本公司货币基金货币正回购的余额未超过资产净值的20%。

3、期末基金组合剩余期限

(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

本基金在确保基金持有人利益的前提下有权根据环境变化和实

际需要对上述投资决策程序作出调整。

(2) 交易
基金管理人根据投资组合方案制订相关的投资指令。下达给集中交易室执行，基金经理必须遵守交易下单权和交易执行严格分离的规定。集中交易室依据基金的管理指令，统一执行投资组合计划，进行具体品种的交易，将执行结果反馈给基金经理确认。交易指令执行结束后，交易员填写交易回执，经基金经理确认后交给相关客户服务部。

(3) 清算交收
本基金的清算交收、基金会计核算和报表、基金的交易记录和保管由基金运作部负责部门。清算交收是指基金经办的交易指令、交易员的交易回执后，与交易所的对账进行核对。如果发现不同的记录将由交易员和客户服务单位进行核查，在当日及时处理完毕。得到确认无误的交易单据和交易回执后再归档备案。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款利率(税后)。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场发

展状况对基金的资产配置和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比

较基准的调整应经基金管理人和基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并及时予以公告。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基本基金。在一般情况下，其风

险与预期收益低于一般债券型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承诺对基金的准确性、完整性承担责任及个别及连带责任。

基金管理人在此郑重声明：本基金在银行间债券市场进行投资，将严格遵守《全国银行间债券市场债券交易管理办法》。

本基金组合报告由基金管理人编制并披露于本基金2019年第4季度报告，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。

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 活期存款和结算备付金 840,869,390 72.01

2 国债 29,840,769,39 72.01

3 债券回购 - -

4 其他资产 10,998,13650 19.88

其中：应收申购款余额 - -

5 贷款和应收款项 56,330,46300 100.00

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国债 - -

2 其他国债 - -

3 金融债券 9,906,13368 18.22

其中：政策性金融债 9,906,13368 18.22

4 企业债券 - -

5 金融债 - -

6 中期票据 29,444,63671 54.40

7 同业存单 - -

8 其他 - -

9 合计 39,440,769,39 72.02

10 其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券 - -

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名货币市场基金

序号 项目 占基金资产净值的比例 (%)

1 报告期末持有的货币市场基金余额 0.13

其中：定期式理财产品 - -

2 报告期末持有的货币市场基金余额 - -

其中：定期式理财产品 - -

注：报告期内货币市场基金余额超过基金资产净值的简单平均值。

货币正回购的余额不超过基金资产净值的20%的说明

在报告本期内本公司货币基金货币正回购的余额未超过资产净值的20%。

3、期末基金组合剩余期限

(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

本基金在确保基金持有人利益的前提下有权根据环境变化和实

际需要对上述投资决策程序作出调整。

(2) 交易
基金管理人根据投资组合方案制订相关的投资指令。下达给集中交易室执行，基金经理必须遵守交易下单权和交易执行严格分离的规定。集中交易室依据基金的管理指令，统一执行投资组合计划，进行具体品种的交易，将执行结果反馈给基金经理确认。交易指令执行结束后，交易员填写交易回执，经基金经理确认后交给相关客户服务部。

(3) 清算交收
本基金的清算交收、基金会计核算和报表、基金的交易记录和保管由基金运作部负责部门。清算交收是指基金经办的交易指令、交易员的交易回执后，与交易所的对账进行核对。如果发现不同的记录将由交易员和客户服务单位进行核查，在当日及时处理完毕。得到确认无误的交易单据和交易回执后再归档备案。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款利率(税后)。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用，基金管理人可根据市场发

展状况对基金的资产配置和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比

较基准的调整应经基金管理人和基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并及时予以公告。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基本基金。在一般情况下，其风

险与预期收益低于一般债券型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承诺对基金的准确性、完整性承担责任及个别及连带责任。

基金管理人在此郑重声明：本基金在银行间债券市场进行投资，将严格遵守《全国银行间债券市场债券交易管理办法》。

本基金组合报告由基金管理人编制并披露于本基金2019年第4季度报告，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。

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 活期存款和结算备付金 840,869,390 72.01

2 国债 29,840,769,39 72.01

3 债券回购 - -

4 其他资产 10,998,13650 19.88

其中：应收申购款余额 - -

5 贷款和应收款项 56,330,46300 100.00

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国债 - -

2 其他国债 - -

3 金融债券 9,906,13368 18.22

其中：政策性金融债 9,906,13368 18.22

4 企业债券 - -

5 金融债 - -

6 中期票据 29,444,63671 54.40

7 同业存单 - -

8 其他 - -

9 合计 39,440,769,39 72.02

10 其中：剩余期限超过397天的浮动利率债券 - -

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名货币市场基金

序号 项目 占基金资产净值的比例 (%)

1 报告期末持有的货币市场基金余额 0.13

其中：定期式理财产品 - -

2 报告期末持有的货币市场基金余额 - -

其中：定期式理财产品 - -

注：报告期内货币市场基金余额超过基金资产净值的简单平均值。

货币正回购的余额不超过基金资产净值的20%的说明

在报告本期内本公司货币基金货币正回购的余额未超过资产净值的20%。

3、期末基金组合剩余期限

(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

本基金在确保基金持有人利益的前提下有权根据环境变化和实

际需要对上述投资决策程序作出调整。

(2) 交易
基金管理人根据投资组合方案制订相关的投资指令。下达给集中交易室执行，基金经理必须遵守交易下单权和交易执行严格分离的规定。集中交易室依据基金的管理指令，统一执行投资组合计划，进行具体品种的交易，将执行结果反馈给基金经理确认。交易指令执行结束后，交易员填写交易回执，经基金经理确认后交给相关客户服务部。

(3) 清算交收
本基金的清算交收、基金会计核算和报表、基金的交易记录和保管由基金运作部负责部门。清算交收是指基金经办的交易指令、交易员的交易回执后，与交易所的对账进行核对。如果发现不同的记录将由交易员和客户服务单位进行核查，在当日及时处理完毕。得到确认无误的交易单据和交易回执后再归档备案。

九、基金的业绩比较基准

</div