海富通货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第1号)

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

重要提示

海富通货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会2004年11月19日出具的《关于同意海富通货币市场证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2004】194号文)批准募集。本基金的基金合同于2005年1月4日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为2018年1月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日,财务数据和净值表现未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:海富通基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人:张文伟

成立时间:2003年4月18日

电话:021-38650999

联系人:吴晨霄

注册资本:1.5亿元

股权结构:海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BE控股公司49%。

(二)主要人员情况

张文伟先生,董事长、硕士,高级经济师,历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长;海通证券办公室主任,海通证券投资银行总部副总经理、海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。

任志强先生,董事、总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资责任有限公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理,华宝信托投资责任有限公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理,华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理,华宝兴业资产管理(香港)有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司,现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

杨明先生,董事,管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员,交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任,海通证券有限公司新余营业部总经理,海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记,现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑琨先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

陶乐斯(LigiaTorres)女士,董事,法国与墨西哥双重国籍,双硕士学位,曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行,1996年加入法国巴黎银行集团工作,2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官,2010年10月至今任法国巴黎银行美国控股有限公司董事,2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

黄金源(AlexNGKimGuan)先生,董事,马来西亚国籍,文学学士,历任荷兰通用投资银行新加坡代表处客服主任,荷兰通用资本市场远东区域香港公司证券部经理,法国巴黎资产管理亚洲有限公司董事,现任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区投资总监。

郑国汉先生,独立董事,经济学硕士及博士学位,历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授,现任香港岭南大学校长。

巴约特(MarcBayot)先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授,先锋投资(米兰发都柏林)独立副董事长,Fundconnect独立董事长,Degroof资产管理(布鲁塞尔)独立董事和法国巴黎银行BControlSICAV独立董事。

杨国平先生,独立董事,硕士,高级经济师,历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记,上海市公用事业管理局党办副主任,上海市出租汽车公司党委书记,现任大众交通(集团)股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业(集团)股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

张馨先生,监事,博士,教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院,历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长,现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

李磊前先生,监事长,经济学硕士,高级经济师,历任安徽省财政厅中企处副主任科员,安徽省国有资产管理局科员,海通证券计划财务部副总经理,总经理和财务总监。

魏海诺(BrunoWeil)先生,监事,法国籍,博士,历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理,法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表,南京银行副行长,现任法国巴黎银行集团(中国)副董事长。

俞涛先生,监事,博士,CFA,先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理(英国)有限公司,曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月起任海富通基金管理有限公司产品与创新总监。2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

陈虹女士,监事,法学士,历任香港的近律师事务所上海代表处律师,工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法务经理,现任海富通基金管理有限公司法律部总经理。

奚万荣先生,督察长,经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行英美分行会计主管,海通证券股份有限公司内部审计,2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起,任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

章明女士,副总经理,硕士。历任加拿大BBCCTech&TradeInt'llnc公司高级财务经理、加拿大FutureElectronics公司产品专家,国信证券业务经理和副高级研究员,海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长,2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。2016年12月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

陶网雄先生,副总经理,硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,2003年4至2006年4月任公司财务部负责人,2006年4月起任财务总监。2013年4月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

何树方先生,副总经理,博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长、魁北克蒙特利尔大学研究助理(兼职)、魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理,富国基金管理有限公司总经理助理,2011年6月加入海富通基金管理有限公司,任总经理助理。2014年11月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈铁平先生,博士,CFA,历任MarinerInvestmentGroupLLC数量金融分析师、瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理,基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资部副总监兼债券基金部总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押融投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月起兼任海富通富源新债券和海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通欣悦混合、海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。

谈云飞女士,硕士。2005年4月至2014年6月就职于华宝兴业基金管理有限公司,曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理。2014年6月加入海富通基金管理有限公司。2014年7月至2015年10月任海富通现金管理货币基金经理。2014年9月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2015年1月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015年4月起兼任海富通新内需混合基金经理。2016年2月起兼任海富通货币基金经理。2016年4月至2017年6月任海富通纯债债券、海富通双福分级债券及海富通货币基金经理。2016年4月起兼任海富通养老收益混合基金经理。2016年9月起兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017年7月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。

何谦先生,硕士。历任平安银行资金交易员,华安基金管理有限公司债券交易员,2014年6月加入海富通基金管理有限公司,任海富通货币基金经理助理。2016年5月至2017年10月兼任海富通双利债券基金经理。2016年5月起任海富通纯债债券、海富通双福分级债券及海富通货币基金经理。2016年9月起兼任海富通集利债券基金经理。2017年8月起兼任海富通添益货币基金经理。

本基金历任基金经理为邵佳民先生,任职时间为2005年1月至2008年2月;张丽洁女士,任职时间为2008年2月至2013年1月,位慧先生,任职时间为2013年1月至2014年3月。

投资决策委员会常设委员有:任志强,总经理;胡光涛,总经理助理;王智慧,总经理助理;孙海忠,总经理助理兼固定收益投资总监;杜晓海,多资产策略投资部总监;王金祥,研究副总监;陈甦瑛,量化投资部总监;陈铁平,固定收益投资副总监;赵赫,年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任,讨论内容涉及特定组合的,则该组合投资经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称“中国银行”),基本情况如下:

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾贰万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人:陈四清

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人:王永民

中国银行客服电话:95566

传真:(010)66594942

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1. 直销机构

名称:海富通基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人:张文伟

成立时间:2003年4月18日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2003】48号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.5亿元

存续期间:持续经营

联系人:綦潇菡

客户服务中心电话:40088-40099(免长途话费)

电话:021-38650797

传真:021-33830160

2. 场外销售机构

(1)中国银行股份有限公司

地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:陈四清

电话:010-66596688

传真:010-66593777

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

(2)中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:田国立

传真:010-66275654

客户服务电话:95533

联系人:张静

网址:www.ccb.com

(3)中国工商银行股份有限公司

地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:易会满

客户服务电话:95588

电话:010-66107900

传真:010-66107914

网址:www.icbc.com.cn

(4)交通银行股份有限公司

地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:牛锦明

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司

地址:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:李建红

客户服务电话:95555

联系人:邓刚鹏

网址:www.cmbchina.com

(6)广发银行股份有限公司

注册地址:广东省广州市越秀区东风东路713号

法定代表人:杨明生

客户服务电话:4008308003

网址:www.cgbchina.com.cn

(7)兴业银行股份有限公司

地址:福州市湖东路154号

法定代表人:高建平

客户服务电话:95561

网址:www.cib.com.cn

(8)平安银行股份有限公司

地址:广东省深圳市深南东路5047号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

客户服务电话:95511-3

开放式基金业务传真:0755-25879453

网址:bank.pingan.com

(9)中国民生银行股份有限公司

地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:洪崎

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(10)上海浦东发展银行股份有限公司

地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:高国富

客户服务电话:95528

联系人:高天,虞谷云

网址:www.spdb.com.cn

(11)浙商银行股份有限公司

地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号

法定代表人:沈仁康

客户服务电话:95527

联系人:毛真海

网址:www.czbank.com

(12)宁波银行股份有限公司

地址:宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人:陆华裕

客户服务电话:95574

联系人:胡技勤

网址:www.nbcb.com.cn

(13)华夏银行股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

法定代表人:李民吉

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(14)中国农业银行股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:周慕冰

客户服务电话:95599

传真:010-85108557

网址:www.abchina.com

(15)花旗银行(中国)有限公司

地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦主楼28楼01A单元、02A单元和04单元、29楼02单元,30楼01单元、32楼01单元和01B单元、33楼01单元和03单元、34楼01单元及35楼

法定代表人:欧光伦(AUSIULUEN)

联系人:陈宏

电话:021-28966000

传真:021-28963332

客户服务热线:8008301880

公司网站:www.citibank.com.cn

(16)海通证券股份有限公司

地址:上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人:周杰

客户服务电话:95553或4008888001

联系人:李荣鸣

网址:www.hrsec.com

(17)中信证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦

法定代表人:张佑君

电话:95548

联系人:顾凌

网址:www.cs.ecitic.com

(18)光大证券股份有限公司

地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:薛峰

客户服务电话:95525

联系人:刘晨、李芳芳

网址:www.ebscn.com

(19)国泰君安证券股份有限公司

地址:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:杨德红

客户服务电话:95521

联系人:沈敏祺、吴倩

网址:www.gtja.com

(20)中信建投证券股份有限公司

地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:王常青

客户服务电话:95587

联系人:权唐

网址:www.csc108.com

(21)招商证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:霍达

客户服务电话:95565

联系人:林生迎

网址:www.newone.com.cn

(22)兴业证券股份有限公司

地址:福建省福州市湖东路268号证券大厦17楼

法定代表人:兰荣

客户服务电话:95562

联系人:谢高得

网址:www.xyzq.com.cn

(23)华泰证券股份有限公司

地址:江苏省南京市中山东路228号

法定代表人:周易

客户服务电话:95597或4008895597

联系人:肖亦玲

网址:www.htsc.com.cn

(24)华泰联合证券有限责任公司

地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层

法定代表人:吴晓东

客户服务电话:95513

联系人:盛宗凌

网址:www.lhzq.com

(25)广发证券股份有限公司

地址:广东省广州市天河区天河北路183号大都会广场42楼

法定代表人:孙树明

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

联系人:黄岚

公司网站:new.gf.com.cn

(26)长江证券股份有限公司

地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:尤习贵

客户服务电话:95579或4008888999

联系人:奚博宇

网址:www.95579.com

(27)申万宏源证券有限公司

地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人:李梅

客户服务电话:95523或4008895523

联系人:黄雪

网址:www.swhysc.com

(28)中银国际证券有限责任公司

地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人:宁敏

客户服务电话:4006208888或021-61195566

联系人:王炼哲

网址:www.bocichina.com.cn

(29)东方证券股份有限公司

地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

法定代表人:潘鑫军

客户服务电话:95503

联系人:胡月茹

网址:www.dfzq.com.cn

(30)国信证券股份有限公司

地址:广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层

法定代表人:何如

客户服务电话:95536

联系人:周杨

网址:www.guosen.com.cn

(31)中国银河证券股份有限公司

地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈共炎

客户服务电话:95551或4008888888

联系人:邓颖

网址:www.chinastock.com.cn

(32)平安证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦B座16-20层

法定代表人:詹露阳

客户服务电话:95511转8

联系人:周一涵

网址:stock.pingan.com

(33)世纪证券有限责任公司

地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人:姜昧军

电话:0755-83199599

客户服务电话:4008323000

联系人:袁媛

网址:www.csco.com.cn

(34)中信证券(山东)有限责任公司

地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人:杨宝林

客户服务电话:95548

联系人:赵世营

网址:www.citicsd.com

(35)东北证券股份有限公司

地址:吉林省长春市生态大街6666号

法定代表人:李福春

客户服务电话:95360

联系人:安岩岩

网址:www.nesc.cn

(36)财通证券股份有限公司

地址:杭州杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人:沈继宁

客户服务电话:95336

联系人:夏吉慧

网址:www.ctsec.com

(37)天相投资顾问有限公司

地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人:林义相

客户服务电话:010-66045555、010-66045777、010-66045678(基金)

联系人:谭磊

网址:www.txsec.com

(38)国海证券股份有限公司

地址:广西南宁市滨南路46号国海大厦

法定代表人:何春梅

客户服务电话:95563

联系人:牛孟宇

网址:www.ghzq.com.cn

(39)恒泰证券股份有限公司

地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君庭D座光大银行办公楼14-18层

法定代表人:庞介民

电话:4001961188

联系人:张荣亮

网址:www.cnht.com.cn

(40)瑞银证券有限责任公司

地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人:程宜荪

客户服务电话:4008878827

联系人:冯爽

网址:www.ubssecurities.com

(41)中航证券有限公司

地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人:王宜四

客服电话:4008895335或95335

联系人:史江磊

网址:www.scstock.com

(42)国元证券股份有限公司

地址:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

法定代表人:蔡咏

客户服务电话:95578或4008888777

联系人:李蔡

网址:www.gyzq.com.cn

(43)德邦证券股份有限公司

住所:上海市福山路500号城建国际中心29层

法定代表人:姚文平

客户服务电话:4008888128

联系人:朱磊

网址:www.tebon.com.cn

(44)中泰证券股份有限公司

地址:山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人:李玮

客户服务电话:95538

联系人:许曼华

网址:www.zts.com.cn

(45)第一创业证券股份有限公司

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:刘学民

客户服务电话:95358

联系人:毛诗莉

网址:www.firstcapital.com.cn

(46)湘财证券股份有限公司

地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人:林俊波

客户服务电话:4008881551

联系人:胡雪

网址:www.xcsc.com

(47)安信证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人:王连志

客户服务电话:95517

联系人:陈剑虹

网址:www.essence.com.cn

(48)中国中投证券有限责任公司

地址:广东省深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋4层、18-21层

法定代表人:高涛

客户服务电话:95532或4006008008

联系人:刘毅

网址:www.china-invs.cn

(49)中国国际金融股份有限公司

地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层

法定代表人:丁学东

公司总机:010-65051166(北京);021-58796226(上海)

联系人:王少立

网址:www.cicc.com

(50)中国民族证券有限责任公司

地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F

法定代表人:赵大建

客户服务电话:4008895618

联系人:李微

网址:www.e5618.com

(51)华宝证券有限责任公司

地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

法定代表人:陈林

客户服务电话:4008209898

联系人:刘闻川

网址:www.cnhbstock.com

(52)信达证券股份有限公司

地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:张志刚

客户服务电话:95321

联系人:尹旭航

网址:www.cindasc.com

(53)长城证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:丁益

客户服务电话:4006666888

联系人:邹舒丽

网址:www.cgws.com

(54)方正证券股份有限公司

地址:湖南长沙芙蓉中路二段200号华侨国际大厦22-24层

法定代表人:高利

客户服务电话:95571

联系人:郭军瑞

网址:www.foundersc.com

(55)华福证券有限责任公司

地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人:黄金琳

客户服务电话:0591-96326(福建)或4008896326(全国)

联系人:张腾

网址:www.hfzq.com.cn

(56)渤海证券股份有限公司

地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:王春峰

客户服务电话:4006515988

联系人:王兆权

网址:www.ewww.com.cn

(57)东莞证券股份有限公司

地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:张运勇

客户服务电话:95328

联系人:梁建伟

网址:www.dgzq.com.cn

(58)广州证券股份有限公司

地址:广东省广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19层、20层

法定代表人:刘东

客户服务电话:95396

联系人:林洁茹

网址:www.gzs.com.cn

(59)上海证券有限责任公司

地址:上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人:李俊杰

客户服务电话:4008918918或021-962518

联系人:邵珍珍

网址:www.962518.com

(60)大通证券股份有限公司

地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层

法定代表人:赵俊

客户服务电话:4008169169

联系人:谢立军

网址:www.daton.com.cn

(61)江海证券有限公司

地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:周俊

客服电话:4006662288

网址:www.jhzq.com.cn

(62)山西证券股份有限责任公司

地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:侯巍

客户服务电话:95573

联系人:张治国

网址:www.i618.com.cn

(63)国都证券股份有限公司

地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

法定代表人:王少华

客户服务电话:4008188118

联系人:黄静

网址:www.guodu.com

(64)东兴证券股份有限公司

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

客户服务电话:95309

联系人:汤漫川

网址:www.dxzq.net

(65)财富证券有限责任公司

地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

法定代表人:蔡一兵

电话:95317或4008833516

联系人:邹磊

网址:www.cfzq.com

(66)民生证券股份有限公司

地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A层18层

法定代表人:余政

客户服务电话:4006198888

联系人:赵阳

网址:www.mszq.com

(67)华龙证券股份有限公司

地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心

法定代表人:李晓安

客户服务电话:0931-95368(甘肃)或4006898888(全国)

联系人:范坤

网址:www.hlzq.com

(68)英大证券有限责任公司

地址:广东省深圳市福田区深南中路华能大厦30楼

法定代表人:吴骏

客户服务电话:4000188688

联系人:李欣

网址:www.ydsc.com.cn

(69)中山证券有限责任公司

地址:广东省深圳市南山区科技中一路华强高新发展大厦7-8楼

法定代表人:黄扬录

客户服务电话:95329

联系人:罗艺琳

网址:www.zszq.com

(70)红塔证券股份有限公司

地址:云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦7-11楼

法定代表人:况雨林

客户服务电话:4008718880

联系人:刘晓明

网址:www.hongtastock.com

(71)国融证券股份有限公司

地址:内蒙古呼和浩特市武川县腾飞大道(腾飞大道1号)与呈祥路交汇处武川立农村镇银行股份有限公司四楼

法定代表人:侯守法

客户服务电话:95385

联系人:虞哲惟

网址:www.grzq.com

(72)国联证券股份有限公司

地址:无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

法定代表人:姚志勇

客户服务电话:95570

联系人:沈刚

网址:www.glsc.com.cn

(73)华西证券股份有限公司

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:杨炯洁

客户服务电话:95584

联系人:周志茹

网址:www.hx168.com.cn

(74)西藏东方财富证券股份有限公司

地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座9、10、11、16、17、18层

法定代表人:陈宏

客户服务电话:95357

联系人:周艳琼

网址:www.xzsec.com

(75)财达证券有限责任公司

地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23-26层

法定代表人:翟建强

客户服务电话:4006128888

联系人:李卓颖

网址:www.s10000.com

(76)太平洋证券股份有限公司

地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼

法定代表人:李长伟

客户服务电话:4006650999

联系人:唐昌田

网址:www.tpyzq.com

(77)开源证券股份有限公司

地址:西安市雁塔区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人:李刚

客户服务电话:4008608866

联系人:袁伟涛

网址:www.kyzq.com.cn

(78)华金证券股份有限公司

地址:上海市浦东新区杨高南路759号30层

法定代表人:宋卫东

客户服务电话:4008211357

联系人:秦臻

网址:www.huajinsc.cn

(79)申万宏源西部证券有限公司

住所:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人:韩志谦

广服务电话:4008000562

联系人:王环春

网址:www.hysec.com

(80)中信期货有限公司

地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

法定代表人:张皓

客户服务电话:4009908826

联系人:韩钰

网址:www.citicsf.com

(81)天风证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人:余磊

电话:027-87107535

传真:027-87618863

客户服务电话:4008005000

联系人:杨晨

官网:www.tfzq.com

(82)宏信证券有限责任公司

地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人:吴玉明

电话:028-86199665

传真:028-86199079

客户服务电话:4008366366

联系人:张曼

网址:www.hxzq.cn

(83)大同证券有限责任公司

地址:山西省太原市小店区长治路111号12、13层

法定代表人:董祥

客户服务电话:4007121212

联系人:薛津

网址:www.dsbc.com.cn

(84)首创证券有限责任公司

地址:北京市西城区德胜门外大街115号

法定代表人:吴涛

客户服务电话:4006200620

联系人:刘宇

网址:www.sczq.com.cn

(85)深圳众禄基金销售股份有限公司

地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元

法定代表人:薛峰

客户服务电话:4006-788-887

联系人:童彩平

网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

(86)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

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

客户服务电话:4000-766-123

联系人:李娜芝

网址:蚂蚁聚宝APP

(87)上海好买基金销售有限公司

地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

法定代表人:陶文斌

客户服务电话:400-700-9665

联系人:陆敏

网址:www.ehowbuy.com

(88)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220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

联系人:单丙烨

客服电话:400-820-2899

公司网站:www.erichfund.com

(89)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号2050室

法定代表人:汪静波

客户服务电话:400-821-5399

联系人:李娟

网址:www.noah-fund.com

(90)上海天天基金销售有限公司

地址:上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路88号金座26楼

法定代表人:其实

客户服务电话:400-1818-188

联系人:王超

网址:www.1234567.com.cn

(91)和讯信息科技有限公司

地址:上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F

法定代表人:王莉

客户服务电话:400-920-0022

联系人:刘洋

网址:licaike.hexun.com

(92)北京展恒基金销售有限公司

地址:北京顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人:闫振杰

客户服务电话:400-888-6661

联系人:马林

网址:www.myfund.com

(93)浙江同花顺基金销售有限公司

地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人:凌顺平

客户服务电话:0571-88920897、4008-773-772

联系人:董一峰

网址:www.5ifund.com

(94)众升财富(北京)基金销售有限公司

深入分析国家货币政策、短期资金市场利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化,对短期利率走势形成合理预期,并掘此调整基金货币资产的配置策略。

(2)收益率曲线分析策略

根据收益率曲线的变化趋势,采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系,反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的预期。

(3)组合剩余期限策略、期限配置策略

通过对组合资产剩余期限的设计、跟踪、调整,达到保持合理的现金流,锁定组合剩余期限,以满足可能的、突发的现金需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,根据收益率曲线的情况,投资一定剩余期限的品种,稳定收益,锁定风险,满足组合目标期限。

(4)类别品种配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

(5)流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施),在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

(6)无风险套利策略

无风险套利策略包括:

跨市场套利策略:根据各细分短期金融工具的流动性和收益特征,动态调整基金资产在各个细分市场之间的配置比例。

跨品种套利策略:根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征,动态调整不同期限结构品种的配置比例。

(7)滚动配置策略

根据具体投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续的变现能力。

本基金的业绩比较基准为,税后一年期银行定期存款利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下,本基金管理人可根据投资目标和投资策略,确定变更业绩比较基准,并及时公告。

本基金管理人认为,业绩的选择标准需要合理、透明,为广大投资者所接受。本业绩基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。

十、基金的风险收益特征

本货币市场基金是具有较低风险、流动性强的基金品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年2月2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。

本投资组合报告所载数据为截至2017年12月31日(“报告期末”)的季报数据,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	5,571,748,526.43	26.34
	其中:债券	5,571,748,526.43	26.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,524,034,486.04	26.11
	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	9,742,211,390.95	46.05
4	其他资产	319,011,688.42	1.51
5	合计	21,157,006,091.84	100.00

2.报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.20
	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	82,169,838.91	0.39
	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的比例为报告期内每个银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金金额超过基金资产净值的20%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资产净值的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
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

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	45.47	0.39
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	10.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	25.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	16.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.03	0.39

4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说