

(上接B14版)

法定代表人:张淑伟
电话:021-40082899
联系人:王瑞芳
电话:021-20699131
网址:www.sicafund.com

128. 四川同创基金销售有限公司
注册地址:成都市高新区交子大道171号元茂大厦900室
办公地址:浙江省杭州市滨江区浦沿街道东信路5号电子商务产业园4楼411室
法定代表人:李春
电话:0571-88911818-8580
电话:0571-88911818-8122
客服电话:4008-771-772
网址:www.sicafund.com

129. 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:上海市浦东新区峨山路514号14幢1402室
法定代表人:李永
电话:021-50583533
电话:021-50583533
客服电话:400-921-7755
网址:www.lidfund.com

130. 上海联泰基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道7号上海国金中心二期33层3312-1515室
法定代表人:赵颖
电话:010-62188188
电话:010-83712289
联系人:郝俊
电话:15921963709
网址:www.lantai-fund.com

131. 南京众安基金销售有限公司
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
法定代表人:王雄
电话:025-84895977
网址:https://www.zoan.com/

132. 北京大晟财富基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1015室1222室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1015室3003室
法定代表人:李永
电话:010-61919685
网址:www.dashengfund.com

133. 北京恒信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108室
法定代表人:王刚
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.hundefund.com

134. 北京汇安基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.huanfund.com

135. 北京坤元基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.kunfund.com

136. 北京康华基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.kangfund.com

137. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

138. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

139. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

140. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

141. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

142. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

143. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

144. 北京乾道基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1012室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号10层1108-1008室
法定代表人:李慧珍
电话:010-56281240
电话:010-62082827
客服电话:400-619-0599
网址:www.qiandao.com

大成货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要

预期收益率高于同期银行存款利率或预期收益率有下降空间的风险。

(2) 短期回购期限品种为一年,具体期限的选择不符合品种和期限结构的合理性,选择收益率相对较高的货币市场投资。

4. 交易策略

基金的投资策略在控制风险的前提下力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的超额收益。基金管理人采取以下策略:

1. 货币市场投资策略

由自由资产和银行间市场具有不同期限利率期限结构和流动性特征,基金可从中捕捉投资机会,比如交易所回购利率与银行间回购利率的套利机会,可叠加交易所与银行间市场利率的套利机会。

2. 跨品种套利策略

由于市场交易活跃度存在差异,导致不同品种收益率曲线结构容易出现不合理的情形,这种失衡为跨品种套利提供机会,比如交易所回购利率与银行间回购利率的套利机会,投资者可从中捕捉投资机会,比如交易所与银行间市场利率的套利机会。

3. 利率发现策略

基金管理人密切跟踪市场利率的变化,发现定价的偏差,利用这种市场机会组合品种的套利和为投资者提供超额收益。比如在年初、年末、新发发行利用市场资金供需、利率走高增加回购比例,在CPI走高、资金面宽松的情况下增加短期相对较长的投资比例。

4. 正回购放大策略

基金管理人密切跟踪市场利率下行或企稳企稳的过程中,方法是转售余额相对较长的短期品种进行正回购操作,随后再次买入短期品种,确保资产低于短期债券余额,该策略可实现滚动收益。

5. 债券价值发现

逆回购策略的目的在识别市场低估定价的债券,进而采取适当的交易以期获利,一方面基金管理人通过短期回购操作,可处于同一风险层次的多只债券中,挖掘更具投资价值品种,另一方面,通过正回购操作,可处于同一风险层次的多只债券中,挖掘更具投资价值品种,另一方面,通过正回购操作,可处于同一风险层次的多只债券中,挖掘更具投资价值品种。

十一、基金的投资业绩比较基准

本基金业绩比较基准为“税后一年期银行定期存款利率”,变更为“税后活期存款利率”。

十二、基金的风险控制特征

本基金投资于中国证监会认可的低风险品种,预期收益和风险都低于债券基金、混合基金、股票基金。

十三、基金的投资组合报告(截至2019年6月30日)

基金管理人遵规运作,报告期内投资组合未发生重大偏离,未出现异常波动,并对其内外的流动性、合规性和风险控制进行了全面评估,报告期内基金运作符合基金合同约定,于2019年6月18日复核了本报告中的财务数据,净值数据和投资组合信息,保证复核内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益资产	93,571,100.38	27.55
	其中:债券	93,571,100.38	27.55
2	买入返售金融资产	-	-
	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	120,343,716.18	35.43
4	其他资产	1,758,335.08	0.52
5	合计	339,668,115.99	100.00

2. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	1.08	-
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

3. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

4. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

4. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

5. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

6. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

7. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

8. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

9. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

10. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

11. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

12. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

13. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

14. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

15. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

16. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

17. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

18. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

19. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

20. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

21. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

22. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

23. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

24. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

25. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

26. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

27. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

28. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

29. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

30. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

31. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

32. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

33. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

34. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

35. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

36. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

37. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

38. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

39. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

40. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

41. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

42. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

43. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

44. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

45. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

46. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

47. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

48. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

49. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

50. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

51. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

52. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

53. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

54. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

55. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

56. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

57. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

58. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

59. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

60. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

61. 报告期末投资组合资产配置情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末资产支持融资余额	9,499,875.25	2.89
2	其中:买断式回购融资	-	-

62. 报告期末投资组合资产配置情况

项目	天数
报告期末投资组合平均存续期限	37
报告期内投资组合平均剩余存续期限最高值	51
报告期内投资组合平均剩余存续期限最低值	15

63. 报告期末投资组合资产配置情况

序号
