关于嘉实货币市场基金收益支付的公告

（2020 年第 5 号）

公告送出日期：2020 年 5 月 20 日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实货币市场基金
基金简称	嘉实货币
基金主代码	070008
基金合同生效日	2005 年 3 月 18 日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《嘉实货币市场基金基金合同》、《嘉实货币市场基金招募说明书》等
收益集中支付并自动结转为基金份额的日期	2020 年 5 月 20 日
收益累计期间	自 2020 年 4 月 20 日 至 2020 年 5 月 19 日止

2 与收益支付相关的其他信息

累计收益计算公式	基金份额持有人累计收益＝∑基金份额持有人日收益（即基金份额持有人的日收益逐日累加） 基金份额持有人日收益＝基金份额持有人当日收益分配前所持有的基金份额×（当日基金收益＋前一工作日未分配收益）/当日基金份额总额（按截位法保留到分，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。）
收益结转的基金份额可赎回起始日	2020 年 5 月 21 日
收益支付对象	2020 年 5 月 20 日在嘉实基金管理有限公司登记在册的本基金份额持有人
收益支付办法	本基金收益支付方式为收益再投资方式
税收相关事项的说明	根据国家相关规定，基金向投资者分配的基金收益，暂免征收所得税
费用相关事项的说明	本基金本次收益分配免收分红手续费和再投资手续费

3 其他需要提示的事项

（1）基金份额持有人所拥有收益结转的基金份额于 2020 年 5 月 20 日直接计入其基金账户，2020年 5 月 21 日起可通过相应的销售机构及其网点进行查询及赎回。

（2）2020 年 5 月 20 日，投资者申购或转换转入的本基金份额不享有当日的分配权益，赎回或转换转出的本基金份额享有当日的分配权益。

（3）通常情况下，本基金的收益支付方式为按日支付，对于目前暂不支持按日支付的销售机构，仍保留每月 20 日集中支付的方式。若该日为非工作日，则顺延到下一工作日。

（4）咨询办法

嘉实基金管理有限公司客户服务电话 400-600-8800，网址：www.jsfund.cn。

代销机构的名称及联系方式在基金管理人网站（www.jsfund.cn）公示，敬请投资者留意。

（上接 C63 版）

·公司研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。

·投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

·在既定的投资目标与原则下，根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型，由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

·独立的交易执行：本基金管理人通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

·动态的组合管理：基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合本基金的现金流量情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态的调整，使之不断得到优化。

风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

九、基金业绩比较基准

沪深 300*50%+ 中债总指数 *50%

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 3 月 31 日（“报告期末”），本报告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	权益投资	26,519,168.18	9.84
	其中：股票	26,519,168.18	9.84
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	237,295,009.60	88.05
	其中：债券	237,295,009.60	88.05
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	851,367.90	0.32
8	其他资产	4,849,245.59	1.80
9	合计	269,514,791.27	100.00

2．报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	7,272,780.39	3.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	19,147.31	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	168,823.50	0.07
J	金融业	17,964,033.00	7.67
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	1,094,383.98	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	26,519,168.18	11.32

3．报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	151,200	4,880,736.00	2.08
2	600887	伊利股份	122,337	3,652,982.82	1.56
3	601398	工商银行	526,700	2,712,505.00	1.16
4	601318	中国平安	39,100	2,704,547.00	1.15
5	000651	格力电器	39,600	2,067,120.00	0.88
6	601988	中国银行	540,200	1,879,896.00	0.80
7	601128	常熟银行	274,000	1,874,160.00	0.80
8	000001	平安银行	109,800	1,405,440.00	0.60
9	603259	药明康德	11,900	1,076,831.00	0.46
10	601288	农业银行	309,300	1,042,341.00	0.44

4．报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,132,000.00	4.75
2	央行票据	–	–
3	金融债券	120,773,464.80	51.55
	其中：政策性金融债	48,829,894.80	20.84
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	10,013,000.00	4.27
6	中期票据	36,101,500.00	15.41
7	可转债（可交换债）	979,044.80	0.42
8	同业存单	58,296,000.00	24.88
9	其他	–	–
10	合计	237,295,009.60	101.29

5．报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190215	19 国开 15	300,000	30,984,000.00	13.23
2	111914084	19 江苏银行 CD084	300,000	29,106,000.00	12.42
3	111917038	19 光大银行 CD038	200,000	19,446,000.00	8.30
4	1722036	17 交银租赁债 03	110,000	11,189,200.00	4.78
5	190010	19 附息国债 10	100,000	11,132,000.00	4.75

6．报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

7．报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8．报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

9．报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

10．报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

11．投资组合报告附注

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

（1）2020 年 2 月 3 日，中国银保监会深圳监管局发布行政处罚信息公开表（深银保监罚决字〔2020〕7 号），平安银行股份有限公司因汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失、双录”管理审慎性不足、理财销售人员销售话术不当等 11 条违法违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，于 2020 年 1 月 20 日被处以罚款 720 万元。

2019 年 7 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局发布上海银保监局行政处罚信息公开表（沪银保监银罚决字〔2019〕46 号），交银金融租赁有限责任公司因 2017 年至 2018 年对某不动产租赁物未办理权属转移登记，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《金融租赁公司管理办法》第五十八条，于 2019 年 6 月 28 日作出行政处罚决定，责令改正，并处罚款 50 万元。

2020 年 3 月 9 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕3 号），因可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定等行为，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 50 万元的行政处罚。

本基金投资于“平安银行（000001）”、“农业银行（601288）”的决策程序说明：基于对平安银行、农业银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“平安银行”、“农业银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。 本基金投资于“17 交银租赁债 03（1722036）”的决策程序说明：基于对 17 交银租赁债 03 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“17 交银租赁债 03”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他七名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2)

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	50,919.70
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	4,797,106.62
5	应收申购款	1,219.27
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,849,245.59

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113021	中信转债	471,975.00	0.20
2	113028	环境转债	76,805.10	0.03

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

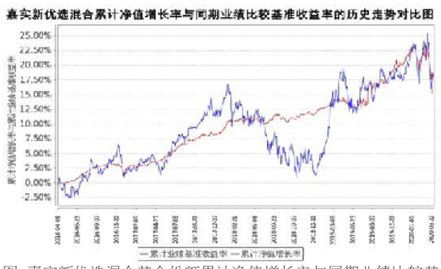
十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日	2.40%	0.08%	1.86%	0.44%	0.54%	-0.36%
2017 年	6.15%	0.09%	9.83%	0.32%	-3.68%	-0.23%
2018 年	2.89%	0.11%	-8.98%	0.66%	11.87%	-0.55%
2019 年	9.35%	0.27%	19.76%	0.61%	-10.41%	-0.34%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日	-3.14%	0.49%	-3.19%	0.93%	0.05%	-0.44%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图：嘉实新优选混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2016 年 4 月 8 日至 2020 年 3 月 31 日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1.基金管理人的管理费；

2.基金托管人的托管费；

3.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费；

5.基金份额持有人大会费用；

6.基金的证券、期货交易费用；

7.基金的银行汇划费用；

8.按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 3 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（二）与基金销售有关的费用

1、本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M<100 万元	1.5%
100 万元≤M<200 万元	1.0%
200 万元≤M<500 万元	0.6%
M≥500 万元	按笔收取，单笔 1000 元

本基金的申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于 0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注：2014 年 9 月 2 日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》，自 2016 年 5 月 9 日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T）	基金网上直销@后端申购优惠费率
0<T<1 年	0.20%
1 年≤T<3 年	0.10%
T≥3 年	0.00%

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5%的赎回费，对持续持有期大于等于 7 天少于 30 日的投资人收取 0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 天少于 90 天的投资人收取 0.5%的赎回费，并将赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期大于等于 90 天少于 180 天的投资人收取 0.5%的赎回费，并将赎回费总额的 50%计入基金财产；对持续持有期大于等于 180 天少于 365 天的投资人收取 0.5%的赎回费，将赎回费总额的 25%计入基金财产；对持续持有期大于等于 365 天少于 730 天的投资人收取 0.25%的赎回费，将赎回费总额的 25%计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（T）	赎回费率
T<7 天	1.5%
7 天≤T<30 天	0.75%
30 天≤T<365 天	0.5%
365 天≤T<730 天	0.25%
T≥730 天	0

3、基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1.在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关内容。

3.在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关内容。

4.在“五、相关服务机构”部分：更新相关代销机构的信息。

5.在“八、基金份额的申购与赎回”部分：更新了申购赎回的相关内容。

6.在“九、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

7.在“十、基金的业绩”部分：更新了基金业绩数据。

8.在“二十一、对基金份额持有人服务”部分：更新了对基金份额持有人服务的相关内容

9.在“二十二、其他应披露事项”部分：更新了临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 05 月 20 日

（上接 C61 版）

(38)西南证券股份有限公司
主册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人：廖庆轩 联系人：周青
电话：023-63786633 传真：023-67616310
客服热线：95355，4008096096 网址：www.swsc.com.cn

(39)华欧(杭州)基金销售有限公司
主册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼
法定代表人：祝国明 联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494 传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn

(40)上海长量基金销售有限公司
主册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人：张跃伟 联系人：马良婷
电话：021-20691832 传真：021-20691861
客户服务电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com

(41)诺正行基金销售有限公司
主册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼
法定代表人：汪静波 联系人：李娟
电话：021-38602377 传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com

(42)上海好天基金销售有限公司
主册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室
法定代表人：杨文斌 联系人：徐超逸
电话：021-20613988 传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665 网址：www.ehowbuy.com

(43)和讯信息科技有限公司
主册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层
法定代表人：王伟刚 联系人：陈慧慧
电话：010-85657353 传真：010-65884788
客户服务电话：400-920-0022 网址：www.licaike.hexun.com

(44)上海天天基金销售有限公司
主册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦
法定代表人：其军 联系人：朱钰
电话：021-54509998 传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188 网址：fund.eastmoney.com

(45)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
主册地址：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 1809
法定代表人：沈伟桦 联系人：程刚
电话：010-52855713 传真：010-85894285
客户服务电话：4006099400 网址：www.yixinfund.com

(46)浙江同花顺基金销售有限公司
主册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室
办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层
法定代表人：凌顺平 联系人：吴强
电话：0571-88911818 传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772 公司网站：www.5ifund.com

(47)上海汇付基金销售有限公司
主册地址：上海市浦东新区黄浦路 333 号 201 室 A 区 056 单元
办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋
法定代表人：金佶 联系人：甄宝林
电话：021-34013996-3011 传真：
客户服务电话：021-34013999 网址：www.hotjijin.com

(48)上海陆金所基金销售有限公司
主册地址：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：郭坚 联系人：宁博宇
电话：021-20665952 传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031 网址：www.lufunds.com

(49)大参宏石基金销售有限公司
主册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室
办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼
法定代表人：袁姗明 联系人：朱真卿
电话：021-22267943 传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266 网址：www.dtfunds.com

(50)上海联泰基金销售有限公司
主册地址：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：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼
法定代表人：燕斌 联系人：陈东
电话：021-52822063 传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788 网址：www.66zichan.com

(51)海银基金销售有限公司
主册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
法定代表人：惠晓川 联系人：毛林
电话：021-80133597 传真：021-80133413
客户服务电话：4008018016 网址：www.fundhaiyin.com

(52)上海凯石财富基金销售有限公司
主册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼
法定代表人：陈继武 联系人：聂佳益
电话：021-80365020 传真：021-63332523
客户服务电话：4006433389 网址：www.vstonewealth.com

(53)上海利得基金销售有限公司
主册地址：珠海市宝山区蕉门路 3475 号 1033 室
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法定代表人：李兴春 联系人：徐鹏
电话：86-021-50583533 传真：86-021-50583633
客户服务电话：400-921-7755 网站：http://a.leadfund.com.cn/

(54)珠海盈米基金销售有限公司
主册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 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 B1201-1203
法定代表人：肖雯 联系人：邱湘湘
电话：020-89629099 传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066 网站：www.yingmi.cn

(55)北京汇成基金销售有限公司
主册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层
法定代表人：王伟刚 联系人：丁向坤
电话：010-56282140 传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059 网站：www.hcjjpm.com

(56)深圳前海微众银行股份有限公司
主册地址：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：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼 ,37 楼
法定代表人：顾敏 联系人：罗曦
电话：0755-89462447 传真：0755-86700688
客户服务电话：400-999-8877 网站：www.webank.com

(57)上海早夏财富投资管理有限公司
主册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址：上海市浦东新区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人：李一梅 联系人：仲秋玥
电话：010-88066632 传真：010-88066552
客户服务电话：4008175666 网站：www.amcfortune.com

(58)和谐保险销售有限公司
主册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 6 号安邦金融中心
法定代表人：蒋洪 联系人：张楠
电话：010-85256214 传真：
客户服务电话：4008195569 网站：www.hx-sales.com

(59)一路财富(北京)基金销售股份有限公司
主册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
法定代表人：吴雪秀 联系人：徐越
电话：010-88312877-8032 传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566 网站：www.yilucaifu.com

(60)嘉禾财富管理有限公司
主册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元
办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层
法定代表人：赵学军 联系人：王宫
电话：021-38789658 传真：021-68880023
客户服务电话：400-640-8800 网站：www.jsfund.cn

(61)北京雷曼陆金销售有限公司
主册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人：钟莹莹 联系人：侯芳芳
电话：010-61840688 传真：010-61840699
客户服务电话：400-1599-288 网站：www.danjuanapp.com

(62)上海基煜基金销售有限公司
主册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人：王翔 联系人：张巍巍
电话：021-63376077-255 传真：021-55085991
客户服务电话：400-820-5369 网站：www.jiyufund.com.cn

(63)开源证券股份有限公司
主册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层
办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层
法定代表人：李刚 联系人：袁伟涛
电话：029-88447611 传真：029-88447611
客户服务电话：95325 或 400-860-8866 网站：www.kysec.cn

(64)华鑫证券有限责任公司
主册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号
法定代表人：俞洋 联系人：杨莉娟
电话：021-54967552 传真：021-54967293
客户服务电话：95323 网站：www.cfsc.com.cn

3.场内销售机构

场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站：http://www.sse.com.cn

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本基金，并在基金管理人网站公示。

（二）其他相关机构

信息类型	注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 30 楼	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
法定代表人	周明	廖海(负责人)	曾顺福
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-61418888
传真	010-59378907	021-51150398	021-61411909
联系人	崔巍	廖海、刘佳	曾浩(曾浩、吴凌志为经办注册会计师)

四、基金的名称

长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型

六、基金的投资目标

本基金为纯债基金，以获取高于银行一年期定期存款利率（税后）×1.3+1.1%的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

八、基金的投资策略

本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

1、封闭期投资策略

（1）资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。

（2）类属配置策略

对于债券资产而言，是信用债、金融债和国债之间的比例配置。当宏观经济转向衰退周期，企业信用风险将普遍提高，此时降低信用债投资比例，降低幅度应该结合利差预期上升幅度和持有期收益分析结果来进行确定。相反，当宏观经济转向复苏，企业信用风险普遍下降，此时应该提高信用债投资比例，提高幅度应该结合利差预期下降幅度和持有期收益分析结果来进行确定。此外，还将考察一些特殊因素对于信用债配置产生影响，其中包括供给的节奏，主要投资主体的投资习惯，以及替代资产的冲击等均对信用利差产生影响，因此，在中国市场分析信用债投资机会，不仅需要分析信用风险趋势，还需要分析供需面和替代资产的冲击等因素，最后，在预期的利差变动范围内，进行持有期收益分析，以确定最佳的信用债投资比例和最佳的信用债持有结构。

（3）个券选择策略

本基金主要根据各品种的收益率、流动性和信用风险等指标，挑选被市场低估的品种。在严控风险的前提下，获取稳定的收益。在确定债券组合久期之后，本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析，结合税收差异、信用风险分析、期权定价分析、利差分析以及交易所流动性分析，判断个券的投资价值，以挑选风险收益相匹配的券种，建立具体的个券组合。

（4）骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度。若收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

（5）息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

（6）利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利