

# 长江乐享货币市场基金招募说明书（更新）

基金管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇一七年六月

## 重要提示

本基金经 2016 年 8 月 1 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予长江乐享货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016] 1729 号文）准予募集注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金不同于银行储蓄与债券，投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力，谨慎做出决策，并自行承担投资风险。

投资人购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人应当全面了解基金的产品特性，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、因较高货币市场利率波动而导致收益率变动的利率风险或负收益风险、因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和长期平均风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载的内容截止日为 2017 年 4 月 26 日，有关财务数据和净值表现截至日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人交通银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

## 第一部分 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 11 楼 10-11 单元

法定代表人：罗国举

办公地址：上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 楼

设立日期：2014 年 9 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2014]871 号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2016]30 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：10 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：赵明

联系电话：021-80301227

股权结构：长江证券股份有限公司持有公司 100% 的股权。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

罗国举先生，硕士。现任长江证券（上海）资产管理有限公司董事长。曾任海南港澳国际信托投资有限公司业务经理，湘财证券有限公司杭州天目山路证券营业部总经理，湘财证券有限公司经纪总部总经理，湘财证券有限公司副总裁、总裁，齐鲁证券有限公司副总裁。

邓晖先生，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司董事、总裁、党委副书记。曾任湖北省邮政储汇局职工，湖北证券公司深圳营业部副总经理、武汉汉口营业部总经理、公司总裁助理兼上海总部总经理，公司副总裁兼经纪事业部总经理，长江证券有限责任公司董事、副总裁，湘财证券有限公司副总裁，德邦证券有限责任公司副总裁、总裁兼德邦期货有限公司董事长，齐鲁证券有限公司党委委员、副总裁、总裁，长江证券股份有限公司监事长。

胡曹元先生，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司副总裁。曾任华中理工大学讲师，中国教育科研计算网华中网络中心 NIC 部主任，大鹏证券有限责任公司信息技术部开发部经理、首席助理总经理、副总经理、总经理，大鹏网络有限责任公司副总经理、董事，大鹏证券有限责任公司信息技术部总经理，长江证券有限责任公司信息技术中心总经理、信息技术总部主管，长江证券股份有限公司营运管理总部主管、执行副总裁。

熊雷鸣先生，硕士，会计师、中国注册会计师。现任长江证券股份有限公司财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司财务总部业务主管、副经理、经理，长江证券有限责任公司财务总部副总经理、长江证券股份有限公司财务总部副总经理、总经理，长江证券股份有限公司职工监事，财务总部副总经理、总经理。

刘元瑞先生，硕士。现任长江证券股份有限公司副总裁、研究所总经理。曾任长江证券股份有限公司研究部分析师、副总经理、总经理。

#### 2、监事

石应刚先生，中共党员，硕士。现任长江证券股份有限公司稽核监察部总经理。曾任武汉证券公司上海业务部交易员、营业部经理，武汉证券交易中心上市稽核部经理、办公室主任，长江证券股份有限公司办公室、董秘室总经理。

### 3、公司高级管理人员

罗国举先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

唐吟波女士，总经理，中共党员，硕士。曾任泰阳证券有限责任公司（现方正证券）上海延安西路证券营业部客户部经理兼办公室主任，德邦证券股份有限公司经纪业务总部营销部总经理，齐鲁证券有限公司（现中泰证券）经纪业务总部副总经理、上海甘河路营业部总经理，长江证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

刘泉先生，合规负责人、首席风险官，中共党员，硕士。曾任职于中国平安保险集团股份有限公司、中国证监会上海监管局，曾任柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司合规负责人。

宋啸啸先生，副总经理，硕士。曾任群茂科技（深圳）有限公司工程师，中国银行总行风险经理，齐鲁证券有限公司执行总经理，长安国际信托有限公司发展研究部总经理。

范海蓉女士，副总经理，中共党员，硕士。曾任招商证券股份有限公司投资银行部项目经理，上海国际信托有限公司资金信托总部研究员、基金经理助理、资本市场主管、股权信托总部总经理助理、副总经理、总经理。

董来富先生，副总经理，中共党员，硕士。曾任中国建设银行支行信贷负责人、分理处主任、营业部副主任、主任、支行行长，湘财证券股份有限公司合肥长江中路营业部总经理，华融证券股份有限公司信用业务部总经理。

### 4、基金经理

漆志伟先生，中国人民大学工商管理硕士，6年固定收益投资研究经验。曾任华农财产保险股份有限公司固定收益研究员、投资经理助理、投资经理。现任长江收益增强债券型证券投资基金基金经理、长江乐享货币市场基金基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

基金投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由董事长罗国举先生、总经理唐吟波女士（兼任基金管理总部总经理）、研究部总经理徐婕女士、基金经理漆志伟先生组成。其中罗国举先生任基金投资决策委员会主任。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。

1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上

海证券交易所挂牌上市。根据 2016 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 13 位，较上年上升 4 位；根据 2016 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 153 位，较上年上升 37 位。

截至 2016 年 12 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 84,031.66 亿元。2016 年 1-12 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 672.10 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

## （三）基金托管业务经营情况

截至 2016 年 12 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 270 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 第三部分 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构（仅销售 A 类基金份额、B 类基金份额）

长江证券（上海）资产管理有限公司直销中心：

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 11 楼 10-11 单元

办公地址：上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 楼

法定代表人：罗国举

联系人：蒋媛媛

电话：021-80301221

传真：021-80301399

客户服务电话：021-80301262

网址：[www.cjzcgl.com](http://www.cjzcgl.com)

## 2、其他销售机构：

### (1) A 类基金份额、B 类基金份额其他销售机构

#### 1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

#### 2) 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 32 层

法定代表人：陆昊

联系人：茆勇强

电话：(021) 61058785

传真：(021) 61642088

客户服务电话：400-111-5818

网址：[www.huaruisales.com](http://www.huaruisales.com)

#### 3) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：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：上海市长宁区福泉北路 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

客服电话：4000-466-788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

#### 4) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、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：贾一夫

电话：010-65215588

传真：010-85097308

客服电话：400-021-8850

网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

5) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：高源

电话：021-20613977

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

6) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

电话：010-62675369

传真：010-62676582

客服电话：010-62675369

网址：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

7) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：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 26 层

法定代表人：其实

联系人：胡阅

电话：(021) 54509988\*5071

传真：(021) 64385308

客户服务电话：4001-818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

8) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：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 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：何心伟

电话：(021) 20691926

传真：(021) 20691861

客服电话：400-820-2899

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

9) 上海华信证券有限责任公司

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼

法定代表人：郭林

电话：(021) 63898970

传真：(021) 63898989

客服电话：4008205999

网址：www.shhxzq.com

10) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：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1201-1203室

法定代表人：肖雯

电话：(020) 89629099

传真：(020) 89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

11) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号栋201室

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1116室及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

电话：(0755) 89460507

传真：(0755) 21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

12) 上海银行股份有限公司

住所：上海市银城中路168号

办公地址：上海市银城中路168号

法定代表人：金煜

电话：(021) 68475888

传真：(021) 68476111

客服电话：95594

网址：www.bankofshanghai.com

## (2) C类基金份额销售机构

长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特8号

办公地址：湖北省武汉市新华路特8号

法定代表人：尤习贵

联系人：毕艇

电话：(027) 65799560

传真：(027) 85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

## (二) 登记机构

名称：长江证券(上海)资产管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1589号长泰国际金融大厦11楼10-11单元

办公地址：上海市浦东新区向城路288号国华人寿金融大厦8楼

法定代表人：罗国举

联系人：管志斌

电话：021-80301276

传真：021-80301393

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、丁媛

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：武汉市武昌区东湖路 169 号众环大厦

办公地址：武汉市武昌区东湖路 169 号众环大厦

负责人：石文先

经办注册会计师：余宝玉、罗明国

联系电话：027-85424319

传真：027-85424329 联系人：余宝玉

第四部分 基金的名称

长江乐享货币市场基金

第五部分 基金的类型

货币市场基金

第六部分 基金的投资目标

本基金将结合国内外环境，综合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现超越业绩比较基准的收益率。

第七部分 基金的投资范围

本基金投资于以下金融工具：

1、现金；

2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；

3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；

4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。

1、资产配置策略

本基金将从宏观经济、货币政策、财政政策、利率走势等方面出发，对市场当期的系统性风险及影响金融市场资金供求状况的因素进行详细分析与预判，在此基础上严控风险，确定组合的平均剩余期限及平均剩余存续期，并据此动态调整投资组合，力争实现基金资产的稳健增值。



## 2、利率策略

本基金综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况，进而判断未来利率水平的变化方向，结合债券的期限结构水平，债券的供给，流动性水平，凸度分析制定出具体的利率策略。

## 3、信用策略

本基金将在基金管理人内部信用评级的基础上，考察信用资质变化、供需关系等因素，对债券与非金融企业债务融资工具进行独立判断与认定。评价债券发行人的信用风险。跟踪债券发行人和债券工具自身的信用质量变化，并结合外部权威评级机构的信用评级结果，确定基金资产对相应债券的投资决策。

## 4、个券选择策略

本基金将以安全性为优先考虑因素，选择央行票据、短期国债和短期融资票据等高信用等级的券品种进行投资以规避风险。并将对不同类别债券产品进行相对价值分析，包括对票息及付息频率、信用风险、隐含期权、债券条款、税赋水平、市场资金结构和流动性等因素进行分析，判断个券的投资价值，选取风险收益相匹配的券种构建投资组合，以获取不同债券类属之间及不同个券间利差变化所带来的投资收益。

## 5、现金流管理策略

本基金作为现金管理工具，具有较高的流动性要求，本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测，通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配，动态调整并有效分配基金的现金流，在保持充分流动性的基础上争取较高收益。

## 6、资产支持证券投资策略

本基金对于资产支持证券，将综合考虑市场利率、发行条款、标的资产的构成、质量及提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳健收益。

## 7、非金融企业债务融资工具投资策略

本基金在综合非金融企业债务融资工具的发行规模、流动性、行业等因素的基础上，主要考虑利率类型、主体资质和剩余期限，充分考虑该投资品种的风险收益特征，谨慎投资。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行最新公布的七天通知存款利率(税后)。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取中国人民银行最新公布的七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，不需召开基金份额持有人大会通过。基金管理人应在调整实施前 2 日在指定媒介上予以公告。

## 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和长期平均风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

## 第十一部分 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### （一）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 1,050,353,130.91 31.44

其中：债券 1,000,353,130.91 29.95

资产支持证券 50,000,000.00

1.50

2 买入返售金融资产 687,190,470.79

20.57

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 1,589,259,215.63 47.58

4 其他资产 13,569,497.50 0.41

5 合计 3,340,372,314.83 100.00

#### （二）报告期债券回购融资情况

序号 项目 占基金资产净值的比例（%）

1 报告期内债券回购融资余额 1.19

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 --

其中：买断式回购融资 --

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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%。

#### （三）基金投资组合平均剩余期限

##### 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 73

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 88

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 35

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

##### 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 37.65 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

2 30天(含)-60天 15.57 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

3 60天(含)-90天 10.45 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

4 90天(含)-120天 13.45 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

5 120天(含)-397天(含) 22.58 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

合计 99.71 -

#### (四) 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### (五) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国家债券 49,771,086.64 1.49

2 央行票据 --

3 金融债券 170,376,682.98 5.11

其中：政策性金融债 170,376,682.98 5.11

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 39,985,001.85 1.20

6 中期票据 --

7 同业存单 740,220,359.44 22.19

8 其他 --

9 合计 1,000,353,130.91 29.98

10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 --

注：上表中付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

#### (六) 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 1111794552 17 湖北银行 CD029 1,000,000 99,689,575.35 2.99

2 1111720047 17 广发银行 CD047 1,000,000 98,918,946.01 2.96

3 1111791548 17 宁波银行 CD024 1,000,000 98,449,961.99 2.95

4 140446 14 农发 46 500,000 50,351,212.17 1.51

5 120220 12 国开 20 500,000 50,042,356.01 1.50

6 160211 16 国开 11 500,000 50,008,799.99 1.50

7 179910 17 贴现国债 10 500,000 49,771,086.64 1.49

8 111792555 17 重庆银行 CD028 500,000 49,657,835.27 1.49  
9 111790235 17 柳州银行 CD001 500,000 49,429,290.09 1.48  
10 111604010 16 中行 CD010 500,000 49,366,722.30 1.48

(七) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 -

报告期内偏离度的最高值 0.0115%

报告期内偏离度的最低值 -0.0561%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0183%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

(八) 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

序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 11789045 17 上和 1A1 500,000.00 50,000,000.00 1.50

(九) 投资组合报告附注

1、本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

2、本基金本报告期内投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

3、其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 13,569,497.50

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 待摊费用 -

7 其他 -

8 合计 13,569,497.50

4、投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占基金总资产或基金资产净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长江乐享货币 A 类份额

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差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

过去三个月 0.8023% 0.0006% 0.3343% 0.0000% 0.4680% 0.0006%

长江乐享货币 B 类份额

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差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

过去三个月 0.8629% 0.0006% 0.3343% 0.0000% 0.5286% 0.0006%

长江乐享货币 C 类份额

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差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

过去三个月 0.7413% 0.0006% 0.3343% 0.0000% 0.4070% 0.0006%

注：(1) 本基金的业绩比较基准为：中国人民银行最新公布的七天通知存款利率(税后)；

(2) 本基金收益分配方式为每日分配、按月支付。

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

注：(1) 本基金基金合同生效日为 2016 年 10 月 26 日，截至本报告期末未满一年；

(2) 按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二) 投资范围”、“(四) 投资限制”的有关约定；(3) 截至本报告期末，本基金尚处在建仓期。

## 第十三部分 基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 4、基金增值服务费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 11、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。

### （二）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 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五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、公休日等，支付日期顺延。

#### 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 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起适用 B 类基金份额的费率。具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 4、基金增值服务费

本基金C类基金份额的增值服务费按前一日该类基金份额基金资产净值的0.50%年费率计提。增值服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金增值服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金增值服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金增值服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第5—11项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （三）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金增值服务费等相关费率。

基金管理人与基金托管人协商一致调低基金销售服务费率、基金增值服务费费率等，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

#### （四）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。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“重要提示”部分更新了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、“第三部分 基金管理人”部分
  - （1）更新了基金管理人概况；
  - （2）更新了主要人员情况；
  - （3）更新了基金管理人的内部控制制度。

- 3、“第四部分 基金托管人”部分
  - (1) 更新了基金托管人基本情况;
  - (2) 更新了基金托管人的内部控制制度;
  - (3) 更新了基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序。
- 4、“第五部分 相关服务机构”部分
  - (1) 更新了基金份额发售机构信息;
  - (2) 更新登记机构信息。
- 5、更新“第六部分 基金的募集”部分;
- 6、更新“第七部分 基金合同的生效”部分;
- 7、“第八部分 基金份额的申购与赎回”部分更新了(二)申购赎回的开放日及时间。
- 8、“第十部分 基金投资组合报告”部分更新了本基金投资组合报告,内容截止至2017年3月31日。
- 9、“第十一部分 基金的业绩”部分更新了本基金的业绩报告,内容截止至2017年3月31日。
- 10、“第二十一部分 托管协议的内容摘要”部分更新了(一)基金托管协议的当事人。
- 11、“第二十二部分 对基金份额持有人的服务”部分更新了(六)基金管理人客户服务联络方式。
- 12、“第二十三部分 其它应披露事项”部分更新了本基金2016年10月26日至2017年4月26日其他应披露的事项。

长江证券(上海)资产管理有限公司  
二〇一七年六月十日