

嘉实机构快线货币市场基金

更新招募说明书

(2015年第1号)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

重要提示

嘉实机构快线货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2014年10月24日证监许可[2014]1115号文注册募集。本基金基金合同于2015年6月25日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实机构快线货币市场基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于货币市场，每万份基金净收益会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者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。投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险等。另外，本基金在上海证券交易所上市交易，对于选择通过二级市场交易的投资者而言，其投资收益为买卖价差收益，交易费用和二级市场流动性因素都会在一定程度上影响投资人的投资收益，本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。本基金为货币市场基金，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并承担基金投资中出现的各类风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为**2015年12月25日**（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为**2015年9月30日**（未经审计）。

目 录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	19
五、相关服务机构.....	23
六、基金份额的分类.....	35
七、基金的募集.....	36
八、基金合同的生效.....	37
九、基金份额的上市交易.....	38
十、基金份额的申购与赎回.....	38
十一、基金的投资.....	55
十二、基金的业绩.....	65
十三、基金的财产.....	69
十四、基金资产的估值.....	70
十五、基金的收益与分配.....	74
十六、基金的费用与税收.....	76
十七、基金的会计与审计.....	79
十八、基金的信息披露.....	80
十九、风险揭示.....	86
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	89
二十一、基金合同的内容摘要.....	91
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	106
二十三、对基金份额持有人的服务.....	122
二十四、其他应披露事项.....	123
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	125
二十六、备查文件.....	126

一、绪言

《嘉实机构快线货币市场基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《货币市场基金管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）和其他有关法律法规以及《嘉实机构快线货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指嘉实机构快线货币市场基金
- 2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《嘉实机构快线货币市场基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实机构快线货币市场基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《嘉实机构快线货币市场基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《嘉实机构快线货币市场基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等，及其不时修订或更新
- 9、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 2 月 17 日修订通过、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并

存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

19、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、基金销售业务：指销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

22、销售机构：指嘉实基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售代理协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过上海证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位

23、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户和/或上海证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构；本基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司和中国证券登记结算有限责任公司

26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金交易而引起的基金份额变动及结余情况的账户

28、上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户，基金投资者通过上海证券交易所办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户

29、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

30、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

31、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》：指由嘉实基金管理有限公司、上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司制定并不时修订，适用于开放式证券投资基金上市、交易、认购、申购、赎回、转换、过户及其他业务方面的规则

39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、场外：指通过上海证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

43、场内：指通过上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

44、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告场内申购对价、赎回对价等信息的文件

45、申购对价：指投资人场内申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代及其他对价

46、赎回对价：指基金份额持有人场内赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给基金赎回人的现金替代及其他对价

47、现金替代：指场内申购、赎回过程中，按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券的一定数量的现金

48、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的场外某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

49、转托管：指基金份额持有人在本基金场外份额的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

50、定期定额投资计划：指投资人通过场外有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

51、巨额赎回：指单个开放日，本基金A类基金份额、B类基金份额、C类基金份额的净赎回申请（三类基金份额的赎回申请份额总数加上基金转换中三类基金份额的转出申请份额总数后扣除A类基金份额的申购申请份额总数及基金转换中转入A类基金份额的申请份额总数后的余额）超过上一开放日三类基金份额总份额的10%的情形，即认为A类/B类/C类基金份额发生了巨额赎回；单个开放日，本基金H类基金份额的基金份额净赎回申请（H类基金份额的赎回申请份额总数扣除H类基金份额的申购申请份额总数后的余额）超过上一开放日H类基金总份额的10%，即认为H类基金份额发生了巨额赎回

52、元：指人民币元

53、基金收益：指基金投资所得债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额

54、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

55、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

56、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

57、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率的过程

58、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

59、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

60、摊余成本法：指估值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，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益

61、每万份基金净收益：指按照相关法规计算的每万份场外基金份额的日净收益

62、每百份基金净收益：指按照相关法规计算的每百份场内基金份额的日净收益

63、七日年化收益率：指以最近七个自然日（含节假日）的基金净收益折算出的年收益率

64、收益账户：指本基金为投资人分配的虚拟账户，用于登记投资人场内基金份额的累计未付收益

65、销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中扣除，属于基金的营运费用

三、基金管理人

(一) 基金管理人基本情况

1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期46层06-08单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	邓红国
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

2、管理基金情况

截止2016年1月23日，基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、79只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、

嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

(二) 主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士，中共党员，1983 年 3 月至 1992 年 2 月任物资部研究室、政策体制法规司副处长，1992 年 3 月至 2003 年 4 月任中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员，2003 年 5 月至 2010 年 3 月任中国银监会银行监管三部副主任、四部主任，2010 年 4 月至 2014 年 10 月任中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人，2014 年 12 月 2 日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

苗菁先生，董事，学士学位，中共党员。曾任中煤信托有限责任公司国际业务部项目经理、投资管理部业务经理；2004 年 3 月至今历任中诚信托有限责任公司投资管理部业务经

理、副经理、经理、投资总监兼投资管理部经理；现任中诚信托有限责任公司投资总监、公司副总经理、公司党委委员。

Bernd Amlung 先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自 1989 年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management, London）全球战略与业务发展部负责人，MD。

Mark Cullen 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD。

韩家乐先生，董事，1990 年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990 年 2 月至 2000 年 5 月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994 年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004 至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997 年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007 年 10 月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001 年 11 月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005 年 9 月至今就职于嘉实基金管理有限

公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2、基金经理

（1）现任基金经理

万晓西先生，13年证券从业经历，曾任职于中国农业银行黑龙江省分行国际业务部、市场开发处及深圳发展银行国际业务部、资金交易中心，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员，第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理，民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理。2007年6月6日至2009年10月20日任南方现金增利货币基金经理。2013年2月加入嘉实基金管理有限公司，现任现金管理部总监，经济学硕士，中国国籍，2013年7月5日至2014年7月16日任嘉实信用债券和嘉实增强收益定期开放债券基金经理，2013年9月4日至2014年9月19日任任嘉实丰益策略定期债券基金经理，2013年12月11日至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金经理，2013年12月18日至今任嘉实活期宝货币基金经理。2014年3月17日至今任嘉实活钱包货币基金经理。2014年6月27日至今任嘉实3个月理财债券基金经理。2015年6月25日至今任本基金基金经理。

张文玥女士，7年证券从业经历。曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币

市场交易员及债券投资经理。2014年4月加入嘉实基金管理有限公司现金管理部。硕士，具有基金从业资格。2014年8月13日至今任嘉实理财宝7天债券、嘉实1个月理财债券、嘉实3个月理财债券、嘉实安心货币基金经理，2015年7月14日至今任嘉实机构快线货币基金经理。

(2) 历任基金经理

无。

3、债券投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，债券投资决策委员会的成员包括：公司固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系资深基金经理王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及投资经理王怀震先生、嘉实国际 CIO Thomas Kwan 先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

(四) 基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金资产；
- (3) 利用基金资产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门调整上述禁止行为的，本基金不受上述限制。

4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人

力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等具体说明。

2、内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

(5) 成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 债券投资决策委员会由公司固定收益业务首席投资官、总监、副总监及资深基金经理、投资经理组成，负责指导固定收益类基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及相关总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

(4) 督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5) 监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6) 业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意

识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

(1) 公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度，督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由监察稽核部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险；

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：186.53 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：朱萍

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年再次更名为资产托管与养老金业务部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

（二）主要人员情况

吉晓辉，男，1955年出生，工商管理硕士，高级经济师。曾任中国工商银行上海浦东分行行长、党委副书记；中国工商银行上海市分行副行长、党委副书记；中国工商银行上海市分行行长、党委书记；上海市政府副秘书长、上海市金融工作党委副书记、上海市金融服务办公室主任、上海国际集团有限公司董事长、党委书记，第十届、第十一届全国政协委员。现任上海浦东发展银行股份有限公司董事长、党委书记。中共上海市第十届委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，研究生学历，高级经济师，曾任上海浦东发展银行空港支行副行长(主持工作)、上海浦东发展银行上海地区总部副总经理、党委委员；上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理；上海浦东发展银行副行长、财务总监；上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行副董事长、行长、党委副书记。

邓从国，男，1962年出生，工商管理硕士，高级会计师。历任河南省财政厅预算处副处长、基本建设处处长，上海浦东发展银行郑州分行副行长、党委委员，参与上海浦东发展银行南昌分行的筹建工作并任分行行长、党委书记。2015年4月1日起任上海浦东发展银行资产托管与养老金业务部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止2015年6月30日，上海浦东发展银行资产托管与养老金业务部共托管证券投资基金三十五只，分别为安信动态策略灵活配置基金、北信瑞丰宜投宝货币、博时安丰18个月LOF、博时产业债纯债债券、东方红稳健精选混合基金、工银瑞信目标收益一年定期开放基金、工银瑞信生态环境行业股票基金、广发小盘成长、国联安货币基金、国联安鑫富混合基金、国联安鑫享混合基金、国联安中债信用债指数增强型基金、国寿安保尊益信用纯债、国泰金龙行业精选、国泰金龙债券、华富保本债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合、华富恒财分级债券、汇添富和聚宝货币、汇添富货币、汇添富双利增强债券、嘉实机构快线货币基金、嘉实优质企业、鹏华丰泰定期开放、天弘新价值灵活配置混合基金、天治财富增长、鑫元合丰分级债券基金、易方达裕丰回报、银华永泰债券型基金、长安鑫利优选混合基金、长信金利趋势、长信利众分级债券型证券投资基金、中海安鑫保本、中海医药健康产业、中信建投稳信债券。合计托管证券投资基金总净值为858.60亿元。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管与养老金业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管和养老金业务的操作风险管控工作。总行资产托管与养老金业务部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；

- (3) 《证券投资基金运作管理办法》;
- (4) 《证券投资基金销售管理办法》
- (5) 《基金合同》、《基金托管协议》;
- (6) 法律、法规、政策的其他规定。

2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督,及时提示基金管理人违规风险。

3、监督方法

(1) 资产托管部设置核算监督岗位,配备相应的业务人员,在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责,规范基金运作,维护基金投资人的合法权益,不受任何外界力量的干预;

(2) 在日常运作中,凡可量化的监督指标,由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督,实现系统的自动跟踪和预警;

(3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等,采取人工监督的方法。

4、监督结果的处理方式

(1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果,采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等;

(2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作,以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人,指明违规事项,明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查,如果基金管理人未予纠正,基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时,基金托管人应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正;

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查,应及时提供有关情况和资料。

五、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构：

(1) 嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心D座12层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵佳		

(2) 嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期46层06-08单元		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	邵琦		

(3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座2单元21层04-05单元		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	王启明		

(4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦16层		
电话	(0755) 25870686	传真	(0755) 25870663
联系人	陈寒梦		

(5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路10号颐和国际大厦A座3502室		
电话	(0532) 66777766	传真	(0532) 66777676
联系人	胡洪峰		

(6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路15号嘉华国际商务中心313室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 87759331

联系人	章文雷
-----	-----

(7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(0591) 88013673	传真	(0591) 88013670
联系人	吴志锋		

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(025) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	徐莉莉		

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元		
电话	(020) 88832125	传真	(020) 81552120
联系人	周炜		

2、代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号		
法定代表人	田国立		
电话	(010) 66596688	传真	(010) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

(2) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址	上海市中山东一路 12 号		
注册地址	上海市中山东一路 12 号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	高天、虞谷云
电话	(021) 61618888	传真	(021) 63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

(3) 青岛银行股份有限公司

住所、办公地址	青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦		
法定代表人	郭少泉	联系人	于庆君
电话	68602127	传真	85709799
网址	www.qdccb.com	客服电话	96588 (青 岛)、

			4006696588（全国）
--	--	--	----------------

(4) 深圳农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦		
法定代表人	李伟	联系人	王璇
电话	0755-25188269	传真	0755-25188785
网址	www.4001961200.com	客服电话	961200（深圳） 4001961200（全国）

(5) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所	东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦。		
办公地址	东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦		
法定代表人	何沛良	联系人	谭少筠
电话	0769-22866255	传真	0769-22866282
网址	www.drcbank.com	客服电话	(0769) 961122

(6) 河北银行股份有限公司

住所、办公地址	石家庄市平安北大街 28 号		
法定代表人	乔志强	联系人	王娟
电话	0311-88627587	传真	0311-88627027
网址	www.hebbank.com	客服电话	4006129999

(7) 苏州银行股份有限公司

办公地址	江苏省苏州市钟园路 728 号		
注册地址	江苏省苏州市东吴北路 143 号		
法定代表人	王兰凤	联系人	熊志强
电话	0512-69868390	传真	0512-69868370
网址	www.suzhoubank.com	客服电话	0512-96067

(8) 威海市商业银行股份有限公司

办公地址	山东省威海市宝泉路 9 号		
注册地址	山东省威海市宝泉路 9 号		
法定代表人	谭先国	联系人	刘文静
电话	0631-5211651	传真	0631-5215726
网址	whshls@163.com	客服电话	4000096636

(9) 和讯信息科技有限公司

办公地址	北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层		
注册地址	北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层		

法定代表人	王莉	联系人	习甜
传真	021-20835879		
网址	http://fund.licaik.com/	客服电话	4009200022

(10) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址	上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼		
注册地址	上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室		
法定代表人	汪静波	联系人	张裕
电话	021-38509735	传真	021-38509777
网址	www.noah-fund.com	客服电话	400-821-5399

(11) 上海天天基金销售有限责任公司

办公地址	上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼		
注册地址	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层		
法定代表人	其实	联系人	潘世友
电话	021-54509998	传真	021-64385308
网址	http://www.1234567.com.cn/	客服电话	400-1818-188

(12) 上海好买基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室		
注册地址	上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室		
法定代表人	杨文斌	联系人	张茹
电话	021-20613999	传真	021-68596916
网址	www.ehowbuy.com	客服电话	4007009665

(13) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼		
注册地址	杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号		
法定代表人	陈柏青	联系人	张裕
电话	021-60897840	传真	0571-26697013
网址	http://www.fund123.cn/	客服电话	4000-766-123

(14) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

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		
注册地址	上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室		
法定代表人	张跃伟	联系人	单丙焯
电话	021-20691869	传真	021-20691861
网址	www.erichfund.com	客服电话	400-089-1289

(15) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼		
注册地址	浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室		
法定代表人	凌顺平	联系人	林海明
传真	0571-86800423		
网址	www.5ifund.com	客服电话	4008-773-772

(16) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址	北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层		
注册地址	北京市顺义区后沙峪镇安富街6号		
法定代表人	闫振杰	联系人	翟飞飞
电话	13520236631	传真	010-62020355
网址	010-62020355	客服电话	4008886661

(17) 嘉实财富管理有限公司

住所	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10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	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

(18) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

办公地址	北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809		
注册地址	北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809		
法定代表人	沈伟桦	联系人	程刚
电话	010-52855713	传真	010-85894285
网址	www.yixinfund.com	客服电话	400-6099-200

(19) 万银财富（北京）基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元		
法定代表人	李招弟	联系人	高晓芳
电话	010-59393923	传真	010-59393074
网址	www.wy-fund.com	客服电话	400-059-8888

(20) 深圳腾元基金销售有限公司

办公地址	广东省深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808室		
------	--------------------------------------	--	--

注册地址	广东省深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 室		
法定代表人	曾革	联系人	鄢萌莎
电话	0755-33376922	传真	0755-33065516
网址	www.tenyuanfund.com	客服电话	4006877899

(21) 中经北证（北京）资产管理有限公司

办公地址	北京市西城区北礼士路甲 129 号 3 号楼创新工场一层 109-1		
注册地址	北京市西城区北礼士路甲 129 号		
法定代表人	徐福星	联系人	徐娜
电话	010-68292940	传真	010-68292941
网址	www.bzfunds.com	客服电话	010-68292745

(22) 上海汇付金融服务有限公司

办公地址	上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼		
注册地址	上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼		
法定代表人	冯修敏	联系人	陈云卉
电话	021-33323998	传真	021-33323837
网址	暂无	客服电话	400-820-2819

(23) 北京乐融多源投资咨询有限公司

办公地址	北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室		
注册地址	北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室		
法定代表人	董浩	联系人	张婷婷
电话	18510450202	传真	010-56580660
网址	www.jimufund.com	客服电话	400-068-1176

(24) 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址	广东省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		
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491		
法定代表人	肖雯	联系人	黄敏嫦
电话	020-89629019	传真	020-89629011
网址	www.yingmi.cn	客服电话	020-89629066

(25) 泉州银行股份有限公司

办公地址	福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
注册地址	福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号		
法定代表人	傅子能	联系人	董培姗、王燕玲

电话	0595-22551071	传真	0595-22578871
网址	http://www.qzccb.com	客服电话	4008896312

(26) 天相投资顾问有限公司

办公地址	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 邮编：100088		
注册地址	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032		
法定代表人	林义相	联系人	尹伶
电话	010-66045529	传真	010-66045518
网址	http://www.jjm.com.cn http://www.txsec.com	客服电话	010-66045678

(27) 国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路 618 号		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号		
法定代表人	杨德红	联系人	芮敏祺
电话	(021) 38676666	传真	(021) 38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

(28) 中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	(010) 65183880	传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

(29) 招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	(0755) 82943666	传真	(0755) 82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008881111、95565

(30) 中国银河证券股份有限公司

住所、办公地址	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	陈有安	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

(31) 长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦		
---------	----------------------	--	--

法定代表人	杨泽柱	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
网址	www.95579.com	客服电话	95579 或 4008-888-999

(32) 渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
办公地址	天津市南开区滨水西道 8 号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022) 28451861	传真	(022) 28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(33) 东吴证券股份有限公司

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路 181 号		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	(0512)65581136	传真	(0512) 65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	4008601555

(34) 信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
法定代表人	高冠江	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
网址	www.cindasc.com	客服电话	95321

(35) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788 、 10108998

(36) 上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼		
法定代表人	龚德雄	联系人	许曼华
电话	(021) 53686888	传真	(021) 53686100-7008
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518 、 4008918918

(37) 国都证券股份有限公司

住所、办公地址	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	常喆	联系人	黄静
电话	(010) 84183389	传真	(010)84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(38) 东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层		
法定代表人	刘化军	联系人	王一彦
电话	(021) 20333910	传真	(021) 50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531; 400-888-8588

(39) 中泰证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 68889155	传真	(0531) 68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

(40) 第一创业证券股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	(0755) 25832852	传真	(0755) 82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

(41) 西部证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼		
法定代表人	刘建武	联系人	刘莹
电话	(029) 87416787	传真	(029) 87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

(42) 华龙证券有限责任公司

住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	(0931) 96668、 4006898888

(43) 上海华信证券有限责任公司

注册地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼		
法定代表人	罗浩	联系人	倪丹
电话	021-38784818	传真	021-68775878

网址	www.shhxzq.com	客服电话	68777877
----	----------------	------	----------

(44) 华鑫证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元		
法定代表人	洪家新	联系人	孔泉
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
网址	www.cfsc.com.cn	客服电话	(021) 32109999 , (029) 68918888

(45) 华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 8 号		
办公地址	北京市西城区金融大街 8 号中国华融 A 座 3 层、5 层		
法定代表人	宋德清	联系人	黄恒
电话	010-58568235	传真	010-58568062
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	(010) 58568118

(46) 宏信证券有限责任公司

办公地址	四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 10 楼		
注册地址	四川成都市人民南路 2 段 18 号川信大厦 11 楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028-86199278	传真	028-86199382
网址	www.hxzq.cn	客服电话	4008366366

3、申购赎回代办券商**(1) 中国银河证券股份有限公司**

住所、办公地址	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	陈有安	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

(2) 海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路 98 号		
办公地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021) 23219000	传真	(021) 23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市 营业网点咨询电话

(3) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788 、 10108998

(二) 登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 46 层 06-08 单元
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层
法定代表人	邓红国
联系人	彭鑫
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678

名称	中国证券登记结算有限责任公司
住所	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人	金颖
联系人	严峰、朱立元
电话	0755-25946013、010-59378839
传真	010-59378907

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼		
负责人	廖海	联系人	刘佳
电话	(021) 51150298	传真	(021) 51150398

经办律师	廖海、刘佳
------	-------

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	洪磊
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	许康玮、洪磊		

六、基金份额的分类

本基金设场外基金份额和场内基金份额。其中，本基金根据投资人持有基金份额时间的不同，对投资人持有的场外基金份额明细按照不同的费率计提管理费，因此形成 A 类、B 类和 C 类三类场外基金份额，本基金的 H 类份额为场内基金份额。

A 类、B 类和 C 类三类基金份额的管理费具体如下：

项目	A类基金份额	B类基金份额	C类基金份额
单笔基金份额明细的持有时间	不满14天	满14天但不满30天	满30天
管理费（年费率）	0.25%	0.22%	0.18%

若投资人认购或申购本基金 A 类基金份额，该笔份额在单个基金账户的持有时间达到 14 天时，该账户持有的该笔份额由 A 类基金份额自动升级为 B 类基金份额；若该笔份额继续持有，持有时间达到 30 天时，该账户持有的该笔份额由 B 类基金份额自动升级为 C 类基金份额。

有效认购的 A 类基金份额自基金合同生效之日起计算持有时间，有效申购的 A 类基金份额自确认之日起计算持有时间。持有时间按自然日计算，满足升级条件的当日若为非工作日，则升级日期可顺延至下一工作日。A 类、B 类、C 类和 H 类基金份额分别设置基金代码，分别公布各类基金份额的每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率。

本基金 A 类基金份额开放认购、申购和赎回业务，B 类和 C 类基金份额是根据持有时间在满足一定条件后由系统自动升级生成，不开放认购和申购业务，只开放赎回业务。

投资人在销售机构进行本基金份额认购、申购和赎回时只使用 A 类基金份额的基金代码。投资人认购、申购申请确认成交后，实际持有的基金份额类别以根据上述规则确认的基金份额类别为准。投资人认购、申购和赎回本基金份额时只使用 A 类基金份额的基金代码，不影响其实际持有的基金份额类别。当投资人实际持有的基金份额所适用的份额类别发生变化的，将自其份额类别变化的当日起适用于新份额类别的管理费年费率。

七、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2014 年 10 月 24 日证监许可[2014] 1115 号文核准募集。

（二）基金类型和存续期间

- 1、基金的类别：货币市场基金。
- 2、基金的运作方式：契约型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

本基金A类、B类、C类基金份额募集期为2015年6月23日。募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

八、基金合同的生效

（一）基金合同的生效

本基金的基金合同于 2015 年 6 月 25 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

九、基金份额的上市交易

（一）基金份额的上市

本基金 H 类基金份额于 2016 年 1 月 11 日在上海证券交易所上市交易，基金场内简称：嘉实快线，基金代码：511960。

（二）H 类基金份额的上市交易

本基金 H 类基金份额在上海证券交易所上市交易的规则、费用、停复牌、暂停上市、恢复上市等需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。

（三）终止上市交易

H 类基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备基金合同或上海证券交易所规定的上市条件；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 个工作日内发布基金终止上市公告。

（四）相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定进行调整的，应当以届时有效的法律法规和规则为准。若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加本基金上市交易方面的新功能，基金管理人与基金托管人协商一致增加相应功能的，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金份额的申购与赎回

（一）申购、赎回的场所

本基金基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式。本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额通过场外方式办理申购和赎回等业务；H 类基金份额通过场内方式

办理申购和赎回等业务。

场外申购和赎回：通过基金管理人的直销中心、网上交易系统及基金场外销售机构的销售网点办理。

场内申购和赎回：通过基金管理人或申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理。

销售机构具体信息由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

（二）申购、赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更、业务操作需要或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购与赎回的开始时间

本基金自 2015 年 6 月 26 日起办理申购与赎回业务。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接收的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回或转换申请。

（三）场外申购与赎回

A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额通过场外进行申购赎回。

（1）申购、赎回的原则

- 1、“确定价”原则，即本基金的申购、赎回的价格为每份基金份额人民币 1.00 元；
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、基金管理人有权对单个基金份额持有人持有本基金份额的数量进行限制，但应最迟在该等限制实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（2）申购、赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项。投资人交付申购款项并由登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请并由登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够可用的基金份额余额。

投资人赎回生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以开放日交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构不晚于 T+1 日对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请已获得确认，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。若申购不成功或无效，则申购款项（不含利息）退还给投资人。

基金管理人可以在不违反法律法规及对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

（3）申购、赎回的数额限制

1、申请申购基金的金额

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购基金份额的单笔最低限额为人民币1.00元，追加申购单笔金额不设限制。投资者通过直销中心柜台首次申购基金份额的单笔最低限额为人民币20,000元，追加申购单笔金额不设限制。

2、申请赎回基金的份额

本基金单笔赎回份额不设限制。本基金对投资者账户的保留余额不设限制。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和

赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

(4) 申购、赎回的费率

本基金初设的基金份额类别不收取申购费用和赎回费用。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可增加收取申购费用或赎回费用的新的基金份额类别，并在该份额类别实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

(5) 申购份额、赎回金额的计算方式

本基金的申购、赎回价格为每份基金份额净值1.00元。

1、申购份额的计算

采用“金额申购”方式，申购价格为每份基金份额净值1.00元，计算公式：

申购份额=申购金额/1.00 元

申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

例一：假定T日申购金额为10,000元，则投资者可获得的基金份额计算如下：

申购份额=10,000/1.00=10,000.00份

2、赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格为每份基金份额净值 1.00 元。赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

赎回金额的确定分两种情况处理：

(1) 部分赎回

投资者部分赎回基金份额时，如其未付收益为正或该笔赎回完成后剩余的基金份额按照 1.00 元人民币为基准计算的价值足以弥补其累计至该日的未付收益负值时，赎回金额如下计算：

赎回金额 = 赎回份额 × 1.00 元

例：假定某投资者在 T 日所持有的 A 类基金份额为 5,032.60 份基金份额，对应的未付收益为 8.48 元，该投资者申请赎回 1,000 份基金份额，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额 = 1,000 × 1.00 元 = 1,000.00 元

投资者部分赎回基金份额时，如其该笔赎回完成后剩余的基金份额按照 1.00 元人民币

为基准计算的价值不足以弥补其累计至该日的未付收益负值时，则将自动按比例结转当前未付收益。

(2) 全部赎回

投资者在全部赎回本基金余额时，基金管理人自动将投资者的未付收益一并结算并与赎回款一起支付给投资者，赎回金额包括赎回份额和未付收益两部分，具体的计算方法为：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times 1.00 \text{ 元} + \text{该份额对应的未付收益}$$

例：假定某投资者在 T 日所持有的 B 类基金份额为 10,000,000.00 份基金份额，且有 15,000.00 元的未付收益。投资者申请全部赎回持有的基金份额，则其获得的赎回金额计算如下

$$\text{赎回金额} = 10,000,000.00 \times 1.00 \text{ 元} + 15,000.00 \text{ 元} = 10,015,000.00 \text{ 元}$$

(四) 场内申购与赎回

H 类基金份额通过场内进行申购赎回。

(1) 申购与赎回的原则

1、“确定价”原则，即本基金的申购、赎回价格以每份 H 类基金份额人民币 100.00 元为基准进行计算；

2、“份额申购、份额赎回”原则，即申购和赎回均以份额申请；

3、本基金的申购对价、赎回对价包括现金替代及其他对价；

4、当日的申购、赎回申请提交后不得撤销；

5、申购、赎回应遵守上海证券交易所和登记机构相关业务规则。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(2) 申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人在申购本基金时须根据申购赎回清单备足相应数量的现金。投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

投资人 T 日赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。

3、申购和赎回申请的确认

如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足，则赎回申请失败。投资人申购、赎回申请按上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则进行确认。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

(3) 申购和赎回的最小申购、赎回单位及数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金最小申购、赎回单位为 1 份。基金管理人可调整最小申购、赎回单位，但必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、基金管理人根据基金每日运作情况，可对基金场内每日总申购份额和赎回份额进行控制并在基金管理人网站公布。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购和赎回的数额限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(4) 申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的资金和基金份额交收适用上海证券交易所和登记机构的结算规则。

投资人 T 日申购、赎回成功后，登记机构在 T+1 日收市后为投资人办理基金份额与现金替代等的交收以及现金差额等的清算，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人与申购赎回代理券商在 T+2 日办理现金差额的交收。

登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

(5) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金采用摊余成本法计价，通过每日计算收益并分配的方式，使每份基金份额净值保持在人民币 100.00 元。

2、本基金不收取申购费用和赎回费用。

3、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的现金替代及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给申请赎回的基金份额持有人的现金替代及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。

4、申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

(6) 申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的申赎现金、申购限额、赎回限额及其他相关内容。

2、申赎现金

本基金采用现金申购、赎回，“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，每一申赎份额对应的申赎现金为 100.00 元人民币。

3、预估现金部分与现金差额

预估现金部分是指由基金管理人估计并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金部分的计算公式如下：

T 日预估现金部分 = $T-1$ 日最小申购赎回单位的基金资产净值 - T 日申赎现金。一般情况下预估现金部分为 0。

T 日现金差额在 $T+1$ 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额 = T 日最小申购赎回单位的基金资产净值 - T 日申赎现金。一般情况下现金差额为 0。

4、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期：	2016-01-11
基金名称：	嘉实快线
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	511960

T-1 日信息内容

现金差额（单位：元）：	0.00
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）：	100.00
基金份额净值（单位：元）：	100.0000

T 日信息内容

预估现金部分（单位：元）：	0.00
现金替代比例上限：	100.000%

是否需要公布 IOPV:	否
最小申购赎回单位 (单位:份):	1
是否允许申购:	是
是否允许赎回:	是

成份券信息内容

股票 代码	股票 简称	股票 数量	现金替代 标志	溢价 比例	固定替代 金额
SSXJ	申赎现金	1			

说明：上述表格仅为示例。

(五) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的场外或\和场内申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理场内申购业务。
- 5、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。
- 6、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。
- 7、本基金出现当日净收益或累计未分配净收益小于零的情形。
- 8、接受某笔或某些申购申请损害现有基金份额持有人利益时。
- 9、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 10、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构等因异常情况无法办理申购业务。
- 11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

除上述第 8 项情形外，发生上述拒绝或暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停基金接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登拒绝或暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项（不含利息）将退还给投资人。在拒绝或暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(六) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的场外和/或场内赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、本基金出现当日净收益或累计未分配净收益小于零的情形。
- 5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 6、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理场内赎回业务。
- 7、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。
- 8、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。
- 9、场内赎回达到基金管理人设定的数额限制。
- 10、基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构等因异常情况无法办理赎回业务。
- 11、接受某笔或某些赎回申请损害现有基金份额持有人利益时。
- 12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

除上述第 9 项情形外，发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案。对于上述第 9 项暂停接受赎回的情形，基金管理人将在基金管理人网站上公布相关赎回上限设定。已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（七）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日，本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额的净赎回申请（三类基金份额的赎回申请份额总数加上基金转换中三类基金份额的转出申请份额总数后扣除 A 类基金份额的申购申请份额总数及基金转换中转入 A 类基金份额的申请份额总数后的余额）超过上一开放日三类基金份额总份额的 10% 的情形，即认为 A 类/B 类/C 类基金份额发生了巨额赎回。

单个开放日，本基金 H 类基金份额的基金份额净赎回申请（H 类基金份额的赎回申请份额总数扣除 H 类基金份额的申购申请份额总数后的余额）超过上一开放日 H 类基金总份额的

10%，即认为H类基金份额发生了巨额赎回。

2、A类\B类\C类基金份额巨额赎回的处理方式

出现A类\B类\C类基金份额巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者A类\B类\C类基金份额的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者A类\B类\C类基金份额的全部赎回申请有困难，或认为兑付投资者A类\B类\C类基金份额的全部赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受A类\B类\C类基金份额赎回比例不低于上一开放日三类基金份额总数10%的前提下，对其余A类\B类\C类基金份额的赎回申请延期办理。对于当日A类\B类\C类基金份额的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回A类\B类\C类基金份额占当日申请赎回A类\B类\C类基金份额总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；A类\B类\C类基金份额的赎回申请未受理部分除投资者在提交A类\B类\C类基金份额赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的A类\B类\C类基金份额赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

(3) 当发生A类\B类\C类基金份额巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上予以公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

(4) 暂停接受和延缓支付：本基金A类\B类\C类基金份额连续2个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受A类\B类\C类基金份额赎回申请；已经确认成功的A类\B类\C类基金份额赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上公告。

3. H类基金份额巨额赎回的处理方式

在H类基金份额发生巨额赎回时，H类基金份额的赎回按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则办理。本基金连续两日以上(含本数)发生H类基金份额的巨额赎回时，如基金管理人认为有必要，可暂停接受H类基金份额的赎回申请；已经接受的H类基金份额赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

(八) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日各类基金份额的每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率。

3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告增加次数。

(九) 基金转换

基金转换是基金管理人给基金份额持有人提供服务的一种服务，是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件将其持有的某一只基金的基金份额转换为同一基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为。

1.基金转换开始日及时间

基金转换的开始办理时间：自 2015 年 6 月 26 日起。

2.基金转换费用

(1)、通过代销机构办理基金转换业务（仅限“前端转前端”的模式）：

①嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转入嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C 时，以及嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B 转入嘉实机构快线货币 A 时不收取转换费用，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

M 为嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B 或嘉实机构快线货币 C、嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实安心货币 A 或嘉实安心货币 B 全部转出时账户当前累计未付收益。

②嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转换为嘉实成长

收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券 A、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实信用债券 A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创 400 联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券 A、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实事件驱动股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益策略定期债券、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实低价策略股票、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实环保低碳股票时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F 为转入基金适用的申购费率；

M 为嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 全部转出时账户当前累计未付收益。

③嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C 转入嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

④嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实优化红利混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实丰益策略定期债券、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票转入嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

⑤嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实中创 400 联接、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证金融地产 ETF 联接转入嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

⑥嘉实债券、嘉实多元债券 A、嘉实信用债券 A、嘉实纯债债券 A、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实丰益信用定期债券 A 转入嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

转入份额=净转入金额/E

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(2)、通过直销(直销柜台及网上直销)办理基金转换业务:

1) 对于“前端转前端”的模式, 采用以下规则:

①嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转入嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实中证中期企业债指数(LOF) C 时, 以及嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B 转入嘉实机构快线货币 A 时不收取转换费用, 计算公式如下:

净转入金额=B×C+M

转入份额=净转入金额/E

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值;

M 为嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C、嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实安心货币 A 或嘉实安心货币 B 全部转出时账户当前累计未付收益。

②嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转换为嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券 A、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实信用债券 A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创 400 联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券 A、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实泰和混合、嘉实先进制造股票、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指

数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实事件驱动股票、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益策略定期债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实低价策略股票、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实环保低碳股票时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F 为转入基金适用的申购费率；

M 为嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 全部转出时账户当前累计未付收益。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销申购优惠费率执行。

③嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C 转入嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

④嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实多元债券 A、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实信用债券 A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创 400 联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券 A、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实泰和混合、嘉实如意

宝定期债券 A、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益策略定期债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实低价策略股票、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实环保低碳股票转入嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

2) 对于“后端转后端”的模式，采用以下规则：

①若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

②若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

注：嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 之间不能相互转换；2015 年 3 月 2 日起，嘉实货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过 200 万元；自 2014 年 5 月 23 日起，嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过 500 万元；2014 年 11 月 13 日起，嘉实纯债债券单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过 100 万元；2015 年 7 月 9 日起，嘉实货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过 500 万元；2015 年 7 月 22 日起，嘉实安心货币单日单个基金账户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过 200 万元；嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯

债定期债券、嘉实对冲套利定期混合为定期开放，在封闭期内无法转换；嘉实如意宝定期债券 A、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实对冲套利定期混合仅适用于其开放期开放转换业务；嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新收益灵活配置混合以及嘉实策略混合、嘉实增长混合等基金暂停申购（含转入）日期，可具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

（十）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给公益性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指登记机构依据司法机构生效司法文书和协助执行通知将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（十一）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有场外基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

（十二）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理场外基金份额的定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十三）基金的冻结和解冻与质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（十四）基金管理人可在不违反相关法律法规、不对现有基金份额持有人实质利益产生不利影响的前提下，根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

十一、基金的投资

（一）投资目标

在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

（二）投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，超短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具（但须符合中国证监会的有关规定）。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、基金风险收益特征的前提下，本基金可参与投资，不需要召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按照届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

（三）投资策略

本基金跟踪分析市场资金面变化及投资者交易行为变化，结合宏观和微观研究制定投资策略，谋求在满足安全性、流动性需要的基础上，实现较高的当期收益。

1、现金流管理策略

本基金持续分析市场资金面，动态预测申购赎回变化，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组合的现金流，以满足流动性需要，为谋求持续较高的稳定收益奠定基础。

2、组合久期投资策略

根据对市场收益率水平变化趋势的判断，本基金动态调整组合久期，以谋求控制风险，增加或锁定收益。当预期市场收益率水平上升时，本基金适当降低组合久期；当预期市场收益率水平下降时，本基金适当增加组合久期。

3、个券选择策略

在个券选择上，本基金通过定性定量方法，综合分析收益率曲线、流动性、信用风险，评估个券投资价值，发掘出具备相对价值的个券。

4、息差策略

本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金运用定性定量方法，评估资产支持证券的个券风险、收益、流动性等，精选个券，分散投资，控制资产支持证券的总体投资比例，控制流动性风险。

6、其他金融工具投资策略

法律法规或监管机构允许货币市场基金投资银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与此类金融工具的投资，不需召开基金份额持有人大会。

7、投资决策

(1) 决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- 2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；
- 3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

(2) 决策程序

- 1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，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。
- 2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。
- 3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。
- 4) 交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。
- 5) 监察稽核部门负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告。

(四) 投资限制

1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票。
- (2) 可转换债券。
- (3) 剩余期限超过 397 天的债券。
- (4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券。

(5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定。

(6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券。

(7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。

2、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天。

(2) 投资于一家公司发行的证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%。

(4) 除发生巨额赎回等证监会规定的情形外，货币市场基金的投资组合中，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

(5) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%。

(6) 本基金投资于定期存款（不包括有存款期限，但根据协议可以提前支取且没有利息损失的银行存款）的比例不得超过基金资产净值的 30%。

(7) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

(9) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天。

(10) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

(11) 债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

(12) 本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准：

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟

踪评级具备下列条件之一：

i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。

3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

4) 本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

(13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

(14) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

除法律法规另有规定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当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基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(6) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

4、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、投资禁止等作

出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

5、投资组合平均剩余期限的计算

(1) 平均剩余期限（天）的计算公式如下：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金）、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、期限在一年以内（含一年）的逆回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会及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。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内（含一年）正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

(2) 各类资产和负债剩余期限的确定

1) 银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天；证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算。

2) 一年以内（含一年）银行定期存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限以存款协议中约定的通知期计算。

3) 组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：
允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算；允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售日的实际剩余天数计算。

4) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数

计算。

5) 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。

6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限。

7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。

8) 法律法规、中国证监会另有规定的，从其规定。

(五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率。活期存款是具备最高流动性的存款，本基金期望通过科学严谨的管理，使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益，因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登公告，而无需召开基金份额持有人大会。

(六) 风险收益特征

本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

(七) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(八) 基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(九) 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 10 月 23

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 2015 年 9 月 30 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	固定收益投资	1,310,914,113.97	31.04
	其中：债券	1,310,914,113.97	31.04
	资产支持证券	-	-
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	2,894,280,404.79	68.54
4	其他资产	17,750,645.99	0.42
	合计	4,222,945,164.75	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.06	
	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	281,259,659.37	7.15
	其中：买断式回购融资	-	-

注：（1）报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。（2）报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

3. 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	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	52
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 120 天。

(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	32.21	7.15
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	49.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	11.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	8.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	5.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.87	7.15

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	321,077,509.22	8.16
	其中：政策性金融债	321,077,509.22	8.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	900,661,692.36	22.89
6	中期票据	-	-
7	同业存单	89,174,912.39	2.27
8	其他	-	-
	合计	1,310,914,113.97	33.31
9	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。

5. 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	011548002	15 中节能 SCP002	2,000,000	199,993,825.58	5.08
2	150211	15 国开 11	1,500,000	150,434,356.08	3.82
3	011599511	15 京国资 SCP001	1,000,000	99,975,388.29	2.54
4	011513002	15 招商局 SCP002	900,000	90,016,824.81	2.29
5	011507003	15 南电 SCP003	700,000	70,052,402.28	1.78
6	011561004	15 五矿股 SCP004	700,000	70,000,066.85	1.78
7	071501009	15 招商 CP009	700,000	69,992,210.00	1.78
8	071502007	15 国泰君 安 CP007	700,000	69,983,995.57	1.78
9	150206	15 国开 06	600,000	60,388,339.99	1.53
10	011528002	15 北车 SCP002	500,000	50,069,895.99	1.27

6. “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0219%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0072%

7. 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资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

8. 投资组合报告附注

(1) 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

(2) 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况

报告期内，本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的 20%。

(3) 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

(4) 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	17,682,789.90
4	应收申购款	67,856.09
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	17,750,645.99

十二、基金的业绩

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。

1. 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

嘉实机构快线货币 A

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
2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年9月30日	0.6149%	0.0015%	0.0939%	0.0000%	0.5210%	0.0015%

嘉实机构快线货币 B

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	③ ③	④ ④
2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年9月30日	0.5212%	0.0024%	0.0939%	0.0000%	0.4273%	0.0024%

嘉实机构快线货币 C

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	⑤ ③	⑥ ④
2015年6月25日（基金合同生效日）至2015年9月30日	0.4375%	0.0031%	0.0939%	0.0000%	0.3436%	0.0031%

2. 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

嘉实机构快线货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

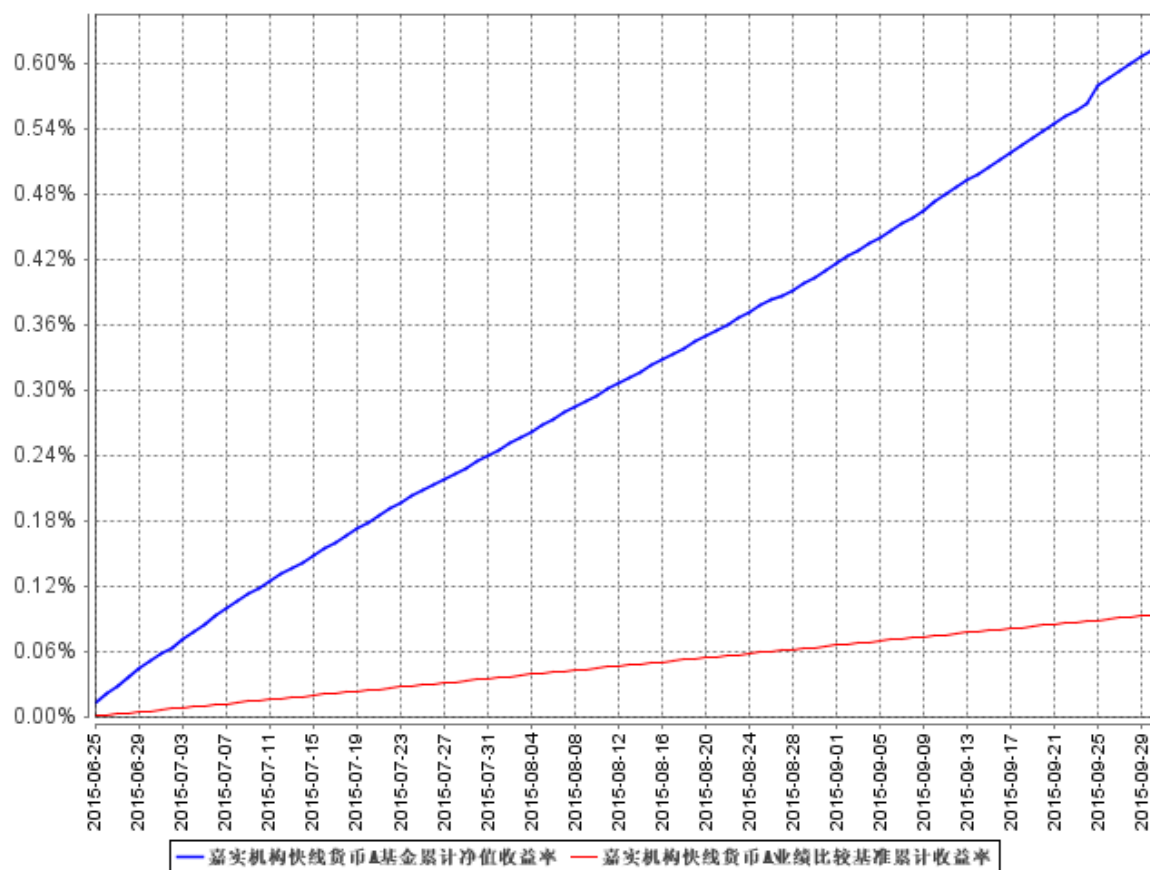


图 1：嘉实机构快线货币 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

图

(2015 年 6 月 25 日至 2015 年 9 月 30 日)

嘉实机构快线货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

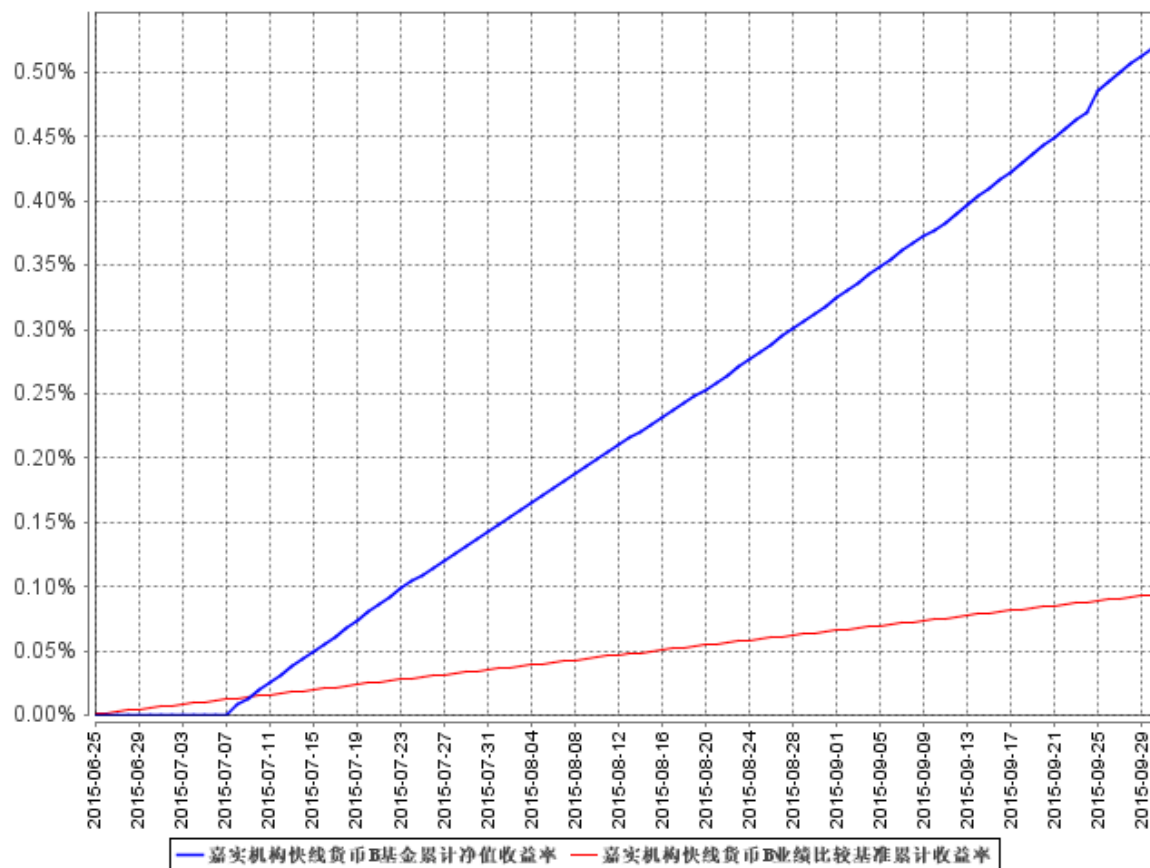


图 2：嘉实机构快线货币 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

图

(2015 年 6 月 25 日至 2015 年 9 月 30 日)

嘉实机构快线货币C基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

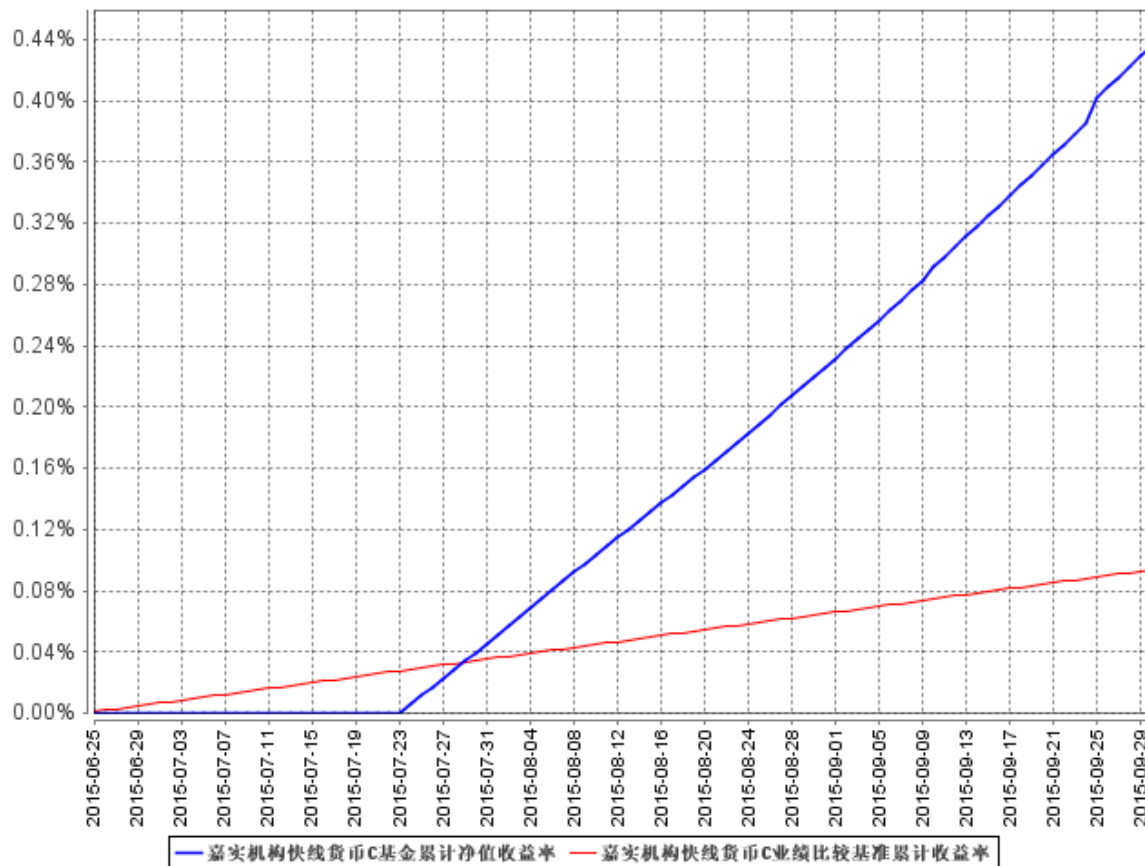


图 3: 嘉实机构快线货币 C 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

图

(2015 年 6 月 25 日至 2015 年 9 月 30 日)

注 1: 本基金基金合同生效日 2015 年 6 月 25 日至报告期末未满 1 年。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, 本报告期处于建仓期内。

注 2: 2015 年 7 月 14 日, 本基金管理人发布《关于新增嘉实机构快线货币基金经理的公告》, 增聘张文玥女士担任本基金基金经理职务, 与基金经理万晓西先生共同管理本基金。

十三、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十四、基金资产的估值

（一）估值目的

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额的基金份额净值保持在人民币 1.00 元，H 类基金份额的基金份额净值保持在人民币 100.00 元。该基金份额净值是计算基金申购与赎回价格的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（三）估值对象

基金所拥有的各类证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（四）估值方法

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，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、为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5% 的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

5、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，

双方协商解决。

基金管理人计算并公告各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率，并由基金托管人复核。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率的计算结果对外予以公布。

（五）估值程序

基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金资产的计价导致每万份或每百份基金净收益小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金估值错误。当七日年化收益率百分号内小数点后 3 位以内（包括 3 位）发生差错时，视为估值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的行为造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金估值错误处理的方法如下：

(1) 基金净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金资产净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

5、特殊情况的处理

基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

十五、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（二）基金收益分配原则

1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3、本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额的分配方式为“每日分配、按日支付”，对于目前暂不支持按日支付的销售机构，仍保留每月集中支付的方式。若该日为非工作日，则顺延到下一工作日。本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，按日支付且结转为相应的基金份额。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

4、本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；

5、本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额每日进行收益计算并分配时，按日支付收益方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人按日支付收益时，其收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其收益为负值，则缩减投资人基金份额；

6、本基金 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额的基金份额持有人在全部赎回其持有的本基金余额时，基金管理人自动将该基金份额持有人的未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回其持有的基金份额时，未付收益为正时，未付收益不进行支付；未付收益为负时，其剩余的基金份额需足以弥补其当前未付收益为负时的损益，否则将自动按比例结转当前未付收益，再进行赎回款项结算；

7、本基金 H 类基金份额根据每日基金收益情况，以每百份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户，投资人收益账户里的累计未付收益和其

持有的基金份额一起参加当日的收益分配。若 H 类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应 H 类基金份额。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）。本基金 H 类基金份额持有人赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人，如累计的基金收益为负，则扣减赎回金额。本基金 H 类基金份额持有人部分卖出 H 类基金份额时，不支付对应的收益，全部卖出 H 类基金份额时，以现金方式将全部累计收益与基金份额持有人结清。若累计收益为负，则投资人应当以现金方式全额弥补，否则基金管理人有权向基金份额持有人进行追索。

8、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

9、当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

10、在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

11、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案由基金管理人拟订、基金托管人复核。

（四）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金每日进行收益分配。每个开放日公告前一个开放日各类基金份额的每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个工作日，披露节假日期间各类基金份额的每万份或每百份基金净收益和节假日最后一日的七日年化收益率，以及节假日后首个开放日各类基金份额的每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

（五）本基金各类基金份额的每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率的计算见基金合同第十九部分第五条第（四）款的规定。

十六、基金的费用与税收

（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、基金的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《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；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的开户费用、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 A 类基金份额年管理费率为 0.25%。

本基金的 B 类基金份额年管理费率为 0.22%。

本基金的 C 类基金份额年管理费率为 0.18%。

本基金的 H 类基金份额年管理费率为 0.25%。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金管理费

E 为前一日该类基金份额（扣除当日该类份额升级的部分）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，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 5 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 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前 5 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

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用。本基金 A 类、B 类、C 类基金份额的销售服务费费率均为 0.01%，H 类基金份额的销售服务费为 0.25%。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可增加收取不同销售服务费用的新的基金份额类别，并在该份额类别实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H=E \times \text{该类基金份额年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额（扣除当日该类份额升级的部分）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。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—11 项费用中除第 8 项外，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。第 8 项费用由基金托管人根据有关法律及相应协议的规定，按费用实际支出支付，由 H 类基金份额持有人承担，列入当期基金费用。

（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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

十八、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体（以下简称“指定媒介”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率

(1) 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率；在开始办理基金份额申购或者赎回当日，披露前一日各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率。

(2) 开放申购或赎回业务后，基金管理人应当在每个开放日的次日，披露开放日各类基金份额的每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率。

(3) 基金管理人在半年度和年度最后一个市场交易日的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）公布该交易日各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率。

A 类基金份额/B 类基金份额/C 类基金份额的每万份基金净收益=[当日该类基金份额基金净收益/当日该类基金份额总额]×10000

上述收益的精度为以四舍五入的方法保留小数点后 4 位。

$$\text{七日年化收益率} = \left\{ \left[\prod_{i=1}^7 \left(1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{\frac{365}{7}} - 1 \right\} \times 100\%$$

其中， R_i 为最近第 i 个自然日 ($i=1, 2, \dots, 7$) 的 A 类基金份额/B 类基金份额/C 类基金份额的每万份基金净收益。

H 类基金份额的每百份基金已实现收益和 7 日年化收益率的计算方法如下：

每百份基金已实现收益 = 当日该类基金份额基金净收益 / 当日该类基金份额总额 $\times 100$

$$\text{七日年化收益率} = \left\{ \left[\prod_{i=1}^7 \left(1 + \frac{R_i}{100} \right) \right]^{\frac{365}{7}} - 1 \right\} \times 100\%;$$

其中， R_i 为最近第 i 个自然日 ($i=1, 2, \dots, 7$) 的 H 份额的每百份基金净收益。

基金七日年化收益率采取四舍五入方式保留至百分号内小数点后第三位，如不足 7 日，则采取上述公式类似计算。

(4) 暂停公告各类基金份额的每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率的情形：

1) 基金投资所涉及的货币市场工具主要交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；

3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

4) 中国证监会或基金合同认定的其他情形。

5、基金申购赎回清单公告

在开始办理 H 类基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日公告当日的申购赎回清单。

6、基金份额上市交易公告书

H 类基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前 3 个工作日将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度

报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

8、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；

- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金改聘会计师事务所；
- (18) 基金变更、增加、减少基金销售机构；
- (19) 基金更换登记机构；
- (20) 本基金开始办理申购、赎回；
- (21) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (22) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (23) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (24) 申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (25) 基金份额持有人大会的决议；
- (26) 基金份额类别的变动；
- (27) 当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过 0.5% 的情形；
- (28) 中国证监会或基金合同规定的其他事项。

9、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金资产净值产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

11、中国证监会规定的其他信息

基金管理人应在基金定期报告中披露其持有的资产支持证券总额、占基金总资产的比例，在基金年报及半年报中披露其期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细，在基金季度报告中披露期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

(六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益、七日年化收益率、及基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒体披露信息,但是其他公共媒体不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

(七) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以供公众查阅、复制。

(八) 暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:

- 1、不可抗力;
- 2、法律法规或基金合同或中国证监会规定的情况。

十九、风险揭示

（一）本基金特有的风险

1、申购赎回风险

（1）本基金基金管理人可在每个开放日对本基金的累计申购/赎回或对单一账户的累计申购/赎回设定上限。如果投资人的申购或赎回申请接受后将使当日申购或赎回相关控制指标超过上限，则投资人的申购或赎回申请可能确认失败。

（2）特定条件下，如基金收益为负、交易所假期休市等情况，基金可能暂停申购，投资人可能面临无法申购本基金的风险。

（3）特定条件下，如基金收益为负、交易所假期休市等情况，基金可能暂停赎回，投资人可能面临无法赎回本基金的风险。

（4）如若基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，可能影响投资人的申购赎回申请，损害投资人利益。

（5）基金管理人可能调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回。

2、场内基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使场内基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

3、基金收益分配风险

（1）作为货币基金，大多数情况下，每日收益为正，但在极端情况下，当基金卖出债券所得收益及利息收入在扣除相关费率之后可能为负，基金当日出现负收益。

（2）本基金场外首次申购和追加申购的最低金额均为 1.00 元，若投资人申购份额较少，由于投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，可能出现当日基金收益无法显示的情况。

（3）本基金场内基金份额的每日收益分配计入投资人收益账户，当收益账户高于 100 元以上时，整百元收益才兑付为基金份额转入投资人的证券账户。投资人可在基金管理人网站查询收益账户明细。投资人卖出部分本基金份额时，不支付对应的收益；但投资人份额全部卖出时，以现金方式将全部累计收益与投资人结清。

4、交易费用及二级市场流动性影响基金收益的风险

本基金在上海证券交易所上市交易，对于选择通过二级市场交易的投资者而言，其投资收益为买卖价差收益，交易费用和二级市场流动性因素都会在一定程度上影响投资者的投资收益。

(1) 通过基金管理人指定的部分券商在二级市场交易基金份额的投资者将豁免征收交易佣金。通过其他券商交易本基金基金份额的投资者将被收取交易佣金，交易佣金会减少投资者的买卖价差收益。

(2) 在其他条件不变的情况下，本基金的二级市场流动性可能影响本基金二级市场的交易价格。即在其他条件不变的情况下，当本基金二级市场流动性较差时，本基金可能出现折价交易或溢价交易。特殊情况下，本基金也可能出现平价交易。

当本基金出现折价交易时，卖出本基金份额持有人需要承受折价卖出的损失；当本基金出现溢价交易时，买入本基金的投资者需要承受溢价买入的损失。当买卖价差收益为负值时，期间投资者的投资收益为负。

5、机会成本风险

由于本基金申购赎回的高效率使本基金对流动性要求更高，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金过多而带来的机会成本风险，本基金长期收益可能低于市场平均水平。

6、系统故障风险

本基金每日进行清算和收益分配，系统实现要求更高，可能出现系统故障导致基金无法正常估值或办理相关业务的风险。

(二) 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于货币市场工具,收益水平会受到利率变化的影响。

4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值,如果发生通货膨胀,基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消,从而影响基金资产的保值增值。

(三) 信用风险

指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失。

(四) 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金,或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

(五) 管理风险

在基金管理运作过程中,可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

(六) 操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在本基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所等等。

(七) 合规性风险

指基金管理或运作过程中,违反国家法律法规的规定,或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

(八) 其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金持有人利益受损。

二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应当报中国证监会备案，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

（1）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）会计师事务所对清算报告进行外部审计；

(6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(7) 将清算结果报告中国证监会;

(8) 公布基金清算公告;

(9) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，因组合中的证券流动性受限无法变现的，可适当延长基金财产清算的期限。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的该基金份额比例进行分配（基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的分配权。每份 H 类基金份额与每 100 份 A 类基金份额\B 类基金份额\C 类基金份额拥有同等分配权，下同）。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金引起本基金基金合同终止的，本基金财产应清理、估价，可根据届时有效的相关规定，本基金财产可不予变现和分配，直接并入或过户至其他基金或新基金中。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项按照基金合同的其他约定执行。

二十一、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人的权利与义务

A. 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《业务规则》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

B. 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规、中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构及其他基金服务机构，对基金销售机构及其他基金服务机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构，并确定相关费率；
- (16) 在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人以基金资产作为担保物进行融资；
- (17) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、定期定额投资、收益分配等方面的业务规则，在法律法规和基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率、托管费率、销售服

务费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

(18) 组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人应当将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

C. 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1) 自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4) 根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算;

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
 - (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
 - (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
 - (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
 - (3) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
 - (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
 - (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
 - (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
 - (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
 - (8) 复核、审查基金管理人计算的各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率；
 - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
 - (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
 - (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
 - (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
 - (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
 - (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
 - (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一份 A 类基金份额、每一份 B 类基金份额、每一份 C 类基金份额拥有平等的权利，持有的每一份 H 类基金份额与每 100 份 A 类/每 100 份 B 类/每 100 份 C 类基金份额享有平等的权利。就 H 类份额进一步澄清：本基金合同第九部分、第十部分及基金合同其他条款中涉及基金份额持有人提议召集召开基金份额持有人大会的权利、提出基金份额持有人大会议案的权利、出席基金份额持有人大会会议的权利及在基金份额持有人大会上的表决权等与基金份额持有人大会相关的权利，H 类份额持有人持有的每一 H 类份额与每 100 份 A 类/每 100 份 B 类/每 100 份 C 类基金份额具有平等的权利。

除上下文另有约定外，在本基金合同第九部分、第十部分中，提及代表特定比例的基金份额或以合并计算本基金基金份额数量为基础计算相关比例时，计算该特定比例的基数或合并计算基金份额应指 H 类份额数量乘以 100 后再加上 A 类、B 类、C 类份额数量之和。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

A. 召开事由

1、除法律法规，或基金合同，或中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；

- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费;
- (6) 变更基金类别;
- (7) 本基金与其他基金的合并;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (9) 变更基金份额持有人大会程序;
- (10) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (11) 法律法规或《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、尽管存有前述约定，但如属于以下情况之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 基金管理人、基金托管人自行决定调低基金管理费、基金托管费;
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (3) 在法律法规和基金合同规定的范围内，且不损害现有基金份额持有人利益的情形下，增加或调整本基金的基金份额类别设置;
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
- (6) 因上海证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动，需要对基金合同进行修改;
- (7) 《基金合同》明确约定无需召开基金份额持有人大会的情况;
- (8) 按照法律法规或《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会情形以外的其他情形。

B. 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

C. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前至少 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计

票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

D. 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式统计基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加统计书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%；

(4) 上述第 (3) 项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持

有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

5、若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第1款第(2)项、第2款第(3)项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的基金份额不少于在权益登记日基金份额总数的三分之一（含三分之一）。

E. 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为本部分第一条“召开事由”第1款所述应当召开基金份额持有人大会审议的事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第G条规定程序确定和公布计票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和

联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人至少提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

F. 表决

基金份额持有人所持每一份 A 类基金份额\每一份 B 类基金份额\每一份 C 类基金份额具有一票表决权，所持每一份 H 类基金份额具有 100 票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并，应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时计票人及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的投资者视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决意见，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

G. 计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名人士共同担任计票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任计票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 计票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。计票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程可以由公证机关予以公证。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名计票人在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

H. 生效与公告

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。该表决通过之日为基金份额持有人大会计票完成且计票结果符合法律法规和基金合同规定的决议通过条件之日。

基金份额持有人大会决议生效后，应按照法律法规的规定报中国证监会备案，并应自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

I. 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

(三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

A. 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应当报中国证监会备案，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

B. 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

C. 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

(1) 基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 会计师事务所对清算报告进行外部审计；

(6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算结果报告中国证监会；

(8) 公布基金清算公告；

(9) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，因组合中的证券流动性受限无法变现的，可适当延长基金财产清算的期限。

D. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

E. 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的该基金份额比例进行分配(基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的分配权。每份 H 类基金份额与每 100 份 A 类基金份额\B 类基金份额\C 类基金份额拥有同等分配权,下同)。

F. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

G. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

H. 本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金引起本基金基金合同终止的,本基金财产应清理、估价,可根据届时有效的相关规定,本基金财产可不予变现和分配,直接并入或过户至其他基金或新基金中。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项按照基金合同的其他约定执行。

(四) 争议的处理

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,各方当事人应尽量通过协商、调解解决。协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

争议处理期间,各方当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律(为本协议之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律)管辖,并按其解释。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所

和营业场所查阅。

二十二、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

A、基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 46 层 06-08 单元

法定代表人：邓红国

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]5 号

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

组织形式：有限责任公司（中外合资）

存续期间：持续经营

电话：010-65215588

B、基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币 186.5347 亿元

经营期限：永久存续

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A. 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，超短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行允许基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具（但须符合中国证监会的有关规定）。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基

金投资目标、基金风险收益特征的前提下，本基金可参与投资，不需要召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按照届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

《基金合同》已明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天。

2) 投资于一家公司发行的证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。

3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%。

4) 除发生巨额赎回等证监会规定的情形外，货币市场基金的投资组合中，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

5) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%。

6) 本基金投资于定期存款（不包括有存款期限，但根据协议可以提前支取且没有利息损失的银行存款）的比例不得超过基金资产净值的 30%。

7) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。

8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

9) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天。

10) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%。

11) 债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

12) 本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准：

a) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

b) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A- 级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+ 级）。

c) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

d) 本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

14) 法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

除法律法规另有规定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当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基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合《基金合同》的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

托管人对上述指标的监督义务，仅限于监督由基金管理人管理且由托管人托管的全部公募基金产品是否符合上述比例限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

(2) 法律法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整（法律法规另有规定除外），以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能的变动规模和公司应对措施，便于基金托管人实施交易监督。

(3) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(4) 相关法律、法规或部门规章规定的其它比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门对《基金合同》所述投资比例、投资限制、组合限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

5、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手的资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并及时书面通知基金托管人。基金托管人据以对基金银行间债券市场交易的交易对手是否符合上述名单进行监督。

(2) 基金托管人对银行间交易市场的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对存款银行的名单予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人据此对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

基金管理人负责对存款银行的资信控制，并对投资银行存款的信用风险（包括但不限于存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等）进行评估。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，由基金管理人负责追偿，基金托管人协助。

7、基金托管人对基金投资中期票据的监督责任仅限于依据本协议第二条第（一）款第2项对投资比例和投资限制进行事后监督；除此外，无其它监督责任。如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人进行监督和核查。基金因投资中期票据导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

基金管理人管理的基金在投资中期票据前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，管理人在此承诺将严格执行该风险控制制度和流动性风险处置预案。

B. 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对各类基金份额的基金资产净值计算、每万份或每百份基金净收益、七日年化收益率，及应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

C. 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议等有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投

资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户和证券账户、是否复核基金管理人计算各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益、七日年化收益率、是否根据管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

A. 基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（托管人主动扣收的汇划费除外）。托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

3、基金托管人按照规定为托管的基金财产开设资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

B. 募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的“募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。基金托管人收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况，并及时将资金到账凭证传真给基金管理人，双方进行账务处理。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

C. 基金资产托管专户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义或以基金的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及托管行的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人保管和使用。

本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要，基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

D. 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人保管证券账户卡原件。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立结算备付金账户，基金托管人代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定和基金托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

E. 银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金管理人和基金托管人应共同负责完成银行间债券市场准入备案。

F. 其他账户的开设和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

G. 基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款，基金管理人与基金托管人应比照证监会《关于货币市场基金投资银行存款有关问题的通知》的规定，就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

H. 基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

I. 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。如确实无法取得两份以上正本的，基金管理人应将一份复印件加盖公章提供给基金托管人。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

（五）基金资产净值的计算和复核

A. 基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。每工作日计算各类基金份额的基

金资产净值、每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率，并按规定公告。

每个工作日，基金管理人应对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

B. 基金资产估值方法

1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2、估值方法

(1) 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，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) 为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

(5) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最

新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

基金管理人计算并公告各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率，并由基金托管人复核。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值、每万份或每百份基金净收益及七日年化收益率的计算结果对外予以公布。

C. 估值差错处理

1、当基金资产的计价导致每万份或每百份基金净收益小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金估值错误。当七日年化收益率百分号内小数点后 3 位以内（包括 3 位）发生差错时，视为估值错误。

基金估值错误处理的方法如下：

基金净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金资产净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

2、本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的行为造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

估值错误处理原则包括：

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向

有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

5、前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

D. 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

E. 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

F. 基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 30 日内完成半年度报告，在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖印鉴或者出具加盖托管业务部门业务章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相

应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

在基金托管人编制半年报和年报前，基金管理人应将每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

（七）争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

2、相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

A. 托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突，并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。基金托管协议的变更报中国证监会备案。本协议约定事项如与法律法规、《基金合同》的规定相冲突，应以法律法规及《基金合同》的规定为准。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

B. 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行外部审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算结果报告中国证监会；
- (8) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，因组合中的证券流动性受限无法变现的，可适当延长基金财产清算的期限。

6、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

7、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

C. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

D. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(九) 基金托管协议的效力

1、本协议经基金管理人、基金托管人双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）并加盖公章（或合同专用章）后成立。本协议以中国证监会注册的文本为正式文本。

2、本协议自《基金合同》生效之日起生效，有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、本协议自生效之日起对各当事人具有同等的法律约束力。

4、本协议一式陆份，除上报有关监管机构贰份外，基金管理人和基金托管人分别持贰份，每份具有同等的法律效力。

二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一) 在线服务

通过本公司网站www.jsfund.cn,基金份额持有人还可获得如下服务:

1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

3、网上交易

本基金管理人已开通个人和机构投资者的网上直销交易业务。个人和机构投资者通过基金管理人网站 www.jsfund.cn 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

(二) 咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打基金管理人全国统一客服电话:400-600-8800(免长途话费)、(010)85712266,传真:(010)65182266。

2、网站和电子信箱

公司网址: <http://www.jsfund.cn>

电子信箱: service@jsfund.cn

二十四、其他应披露事项

自 2015 年 6 月 19 日首次披露本基金招募说明书至 2015 年 12 月 25 日，本基金的临时报告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	嘉实机构快线货币市场基金招募说明书更正公告	2015 年 6 月 20 日	
2	嘉实基金管理有限公司关于嘉实机构快线货币市场基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的提示公告	2015 年 6 月 25 日	
3	关于嘉实机构快线货币市场基金开放日常申购赎回公告	2015 年 6 月 26 日	
4	嘉实机构快线货币市场基金基金合同生效公告	2015 年 6 月 26 日	
5	嘉实基金管理有限公司关于增加上海浦发银行为嘉实金融地产 ETF 联接、嘉实低价策略基金及嘉实机构快线货币代销机构的公告	2015 年 7 月 8 日	
6	关于新增嘉实机构快线货币基金经理的公告	2015 年 7 月 14 日	
7	关于嘉实机构快线货币市场基金收益支付的公告（2015 年第 1 号）	2015 年 7 月 15 日	
8	关于嘉实机构快线货币市场基金收益支付的公告（2015 年第 2 号）	2015 年 8 月 17 日	=
9	关于增加青岛银行等为嘉实机构快线货币基金代销机构及开通定投和转换业务的公告	2015 年 9 月 14 日	
10	关于嘉实机构快线货币市场基金收益支付的公告（2015 年第 3 号）	2015 年 9 月 15 日	
11	关于增加嘉实财富为嘉实旗下基金代销机构的公告	2015 年 9 月 25 日	含本基金
12	关于增加国泰君安和东吴证券为嘉实机构快线货币基金代销机构及开通定投和转换业务的公告	2015 年 10 月 14 日	
13	关于嘉实机构快线货币市场基金收益支付的公告（2015 年第 4 号）	2015 年 10 月 15 日	
14	关于增加盈米财富为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2015 年 10 月 16 日	含本基金
15	关于嘉实机构快线货币市场基金修改费用计提方式并相应修改基金合同等法律文件部分条款的公告	2015 年 10 月 30 日	

16	关于增加中经北证为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2015年11月6日	含本基金
17	关于嘉实机构快线货币市场基金收益支付的公告（2015年第5号）	2015年11月16日	
18	关于增加深圳农商行等为嘉实机构快线货币基金代销机构及开通定投和转换业务的公告	2015年12月14日	
19	关于增加威海市商业银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	2015年12月14日	含本基金
20	关于嘉实机构快线货币市场基金收益支付的公告（2015年第6号）	2015年12月15日	
21	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2015年12月16日	含本基金
22	嘉实基金管理有限公司关于增加上海证券为嘉实机构快线货币市场基金代销机构的公告	2015年12月16日	
23	关于增加中国银行等为嘉实机构快线货币基金代销机构及开通定投和转换业务的公告	2015年12月18日	
24	关于增加泉州银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	2015年12月21日	含本基金
25	关于嘉实机构快线货币市场基金增设场内份额并相应修订基金合同部分条款的公告	2015年12月23日	

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书公布后,分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所,投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

二十六、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册嘉实机构快线货币市场基金募集的文件。
- 2、《嘉实机构快线货币市场基金基金合同》。
- 3、《嘉实机构快线货币市场基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

嘉实基金管理有限公司

2016年2月6日