

# 鹏华添利交易型货币市场基金 B 类份额 上市交易公告书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

B 类份额注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2016 年 2 月 22 日

公告日期：2016 年 2 月 17 日

## 目录

一、	重要声明与提示 .....	3
二、	基金概览 .....	3
三、	基金的募集与上市交易 .....	4
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	8
五、	基金主要当事人简介 .....	9
六、	基金合同摘要 .....	12
七、	基金财务状况 .....	13
八、	基金投资组合 .....	13
九、	重大事件揭示 .....	17
十、	基金管理人承诺 .....	17
十一、	基金托管人承诺 .....	17
十二、	基金上市推荐人意见 .....	18
十三、	备查文件目录 .....	18
附件：	鹏华添利交易型货币市场基金基金合同摘要 .....	19

## 一、 重要声明与提示

《鹏华添利交易型货币市场基金 B 类份额上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,鹏华添利交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读 2016 年 1 月 8 日刊登在《中国证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》。

## 二、 基金概览

- 1、基金名称:鹏华添利交易型货币市场基金
- 2、份额类别:本基金设两类基金份额,A类为场外基金份额,B类为场内基金份额。
- 3、基金二级市场交易简称:鹏华添利
- 4、二级市场交易代码: 511820
- 5、基金场内申购、赎回简称:鹏华添利
- 6、场内申购、赎回代码: 511821
- 7、截至公告日前两个工作日即2016年2月15日基金份额总额: 10,053,020.00份
- 8、截至公告日前两个工作日即2016年2月15日基金份额净值: A类1.00元; B类100元
- 9、本次上市交易份额(B类基金份额): 10,053,020.00份
- 10、上市交易的证券交易所: 上海证券交易所
- 11、上市交易日期: 2016年2月22日
- 12、基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
- 13、基金托管人: 中国工商银行股份有限公司
- 14、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”): 安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证

券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司

### 三、 基金的募集与上市交易

#### (一) 本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2015 年 12 月 23 日证监许可[2015]3046 号。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2016 年 1 月 11 日至 2016 年 1 月 22 日，通过场外认购和场内认购两种方式公开发售。场外认购的发售日期为 2016 年 1 月 11 日至 2016 年 1 月 22 日；网下现金认购的发售日期为 2016 年 1 月 11 日至 2016 年 1 月 22 日，网上现金认购的发售日期为 2016 年 1 月 20 日至 2016 年 1 月 22 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：网下现金认购 10 个工作日，网上现金认购 3 个工作日。

7、发售方式：A 类为场外基金份额，通过场外认购方式发售；B 类为场内基金份额，通过场内认购方式发售。其中，场内认购包括网上现金认购和网下现金认购两种方式。

8、发售机构：

场外认购：

#### (1) 直销机构

鹏华基金管理有限公司直销中心，包括本公司设在深圳、北京、上海、武汉、广州的直销中心。

#### (2) 代销机构

中国工商银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、国都证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京乐融多源投资咨询有限公司、北京增财基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、泛华普益基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海汇付金融服务有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳腾元基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公

司、天相投资顾问有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、中期时代基金销售（北京）有限公司、珠海盈米财富管理有限公司

场内认购：

（1）发售协调人

申万宏源股份有限公司

（2）网下现金认购的直销机构

鹏华基金管理有限公司

（3）网下现金认购的发售代理机构

中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、国都证券股份有限公司、上海证券有限责任公司

（4）网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、长江证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业摩根大通证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海际证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华英证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、九州证券有限公司、开源证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、

摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、日信证券有限责任公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源证券有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、万和证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、网信证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中德证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司和众成证券有限责任公司

上述销售机构排名不分先后。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况：本基金根据中国证监会证监许可[2015]3046号文批准，自2016年1月11日起公开募集，截止2016年1月22日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为1,440,484,999.24元人民币，折合基金份额1,440,484,999.24份；经基金登记结算机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计163,155.65元人民币，折合基金份额163,155.65份，归基金份额持有人所有；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息归入基金财产。募集资金已于2016年1月28日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为4,049户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计163,155.65份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中募集期间基金管理人运用自有资金认购本基金0.00份，占基金总份额0.00%。

11、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》、《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2016年1月29日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（二）基金份额折算

根据《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》和《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，鹏华添利交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）在基金合同生效当日，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）将为本基金B类基金份额办理份额折算，并由登记机构进行B类基金份额的变更登记。折算后B类基金份额持有人持有的基金份额=折算前B类基金份额持有人持有的基金份额/100，折算后B类基金份额对应的面值为100.00元。B类基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后基金份额持有人所持有的基金份额的净值占基金资产净值的比例不发生变化，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。

本基金基金合同于2016年1月29日生效。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。本次募集B类基金份额的认购金额为1,005,302,000.00元，折算前B类基金份额总额为1,005,302,000.00份，折算前基金份额净值为1.00元。根据基金合同中约定的基金份额折算方法，本基金折算后的B类基金份额总额为10,053,020.00份，折算后基金份额净值为100.00元。

本公司已根据上述折算比例，对B类基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2016年1月29日进行了变更登记。

### （三）本基金上市交易的主要内容

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上证自律监管决定书【2016】29号
- 2、上市交易日期：2016年2月22日
- 3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。
- 4、基金二级市场交易简称：鹏华添利
- 5、二级市场交易代码：511820
- 6、基金申购、赎回简称：鹏华添利
- 7、申购、赎回代码：511821

本基金管理人自2016年2月22日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金B类基金份额的申购和赎回。

目前本基金B类基金份额的一级交易商包括：安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、

中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司

上述排名不分先后，本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时公告。

8、本次上市交易份额（B类基金份额）：10,053,020.00份

9、未上市交易份额的流通规定：本基金B类基金份额上市交易后，所有的B类基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的为B类基金份额。本基金A类基金份额为场外份额，不上市交易。

#### 四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### （一）场内持有人户数

截至 2016 年 2 月 15 日，本基金场内份额持有人户数为 2,405 户，平均每户持有的基金份额为 4,180.05 份。

##### （二）场内持有人结构

截至 2016 年 2 月 15 日，本基金场内份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为 3,099,750.00 份，占基金场内总份额的 30.83%；个人投资者持有的场内基金份额为 6,953,270.00 份，占基金场内总份额的 69.17%。

##### （三）前十名场内基金份额持有人情况

截至 2016 年 2 月 15 日，前十名场内基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金场内总份额的比例（%）
1	上海汽车集团财务有限责任公司	705,000.00	7.01%
2	广发证券—广发银行—广发多添富 2 号集合资产管理计划	500,000.00	4.97%
3	深圳市瀚信资产管理有限公司—瀚信定增 3 号 II 证券投资基金	200,000.00	1.99%
4	河南联创工程造价咨询代理有限公司	100,000.00	0.99%
5	瑞源(上海)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	100,000.00	0.99%
6	上海建浦房地产有限公司	100,000.00	0.99%
7	上海申新商业经营管理有限公司	100,000.00	0.99%
8	沈建国	100,000.00	0.99%
9	邹红缨	100,000.00	0.99%
10	陈绮强	100,000.00	0.99%
11	何兆梁	100,000.00	0.99%
12	林丽兰	100,000.00	0.99%
	合计	2305000.00	22.88%

##### （四）截止到 2016 年 2 月 15 日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 121,339.47 份，占该基金总份额的比例为 0.0084%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为 0.00 份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为 0 份。



注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。

## 五、 基金主要当事人简介

### （一） 基金管理人

- 1、名称：鹏华基金管理有限公司
- 2、法定代表人：何如
- 3、总经理：邓召明
- 4、注册资本：1.5 亿元人民币
- 5、注册地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]31 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：4403011013037
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
- 9、存续期间：持续经营

10、股东及其出资比例：公司股东由国信证券有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为 50%、49%、1%。

### 11、内部组织结构及职能：

#### **权益投资一部**

负责公司公募基金产品、社保、企业年金和专户理财投资业务。

#### **权益投资二部**

负责公司公募基金产品和专户理财投资业务。

#### **绝对收益投资部**

以新股业务为核心，包括现有以及即将发行和改造的新股产品，同时兼顾以绝对回报为目标的非保险、社保专户业务。

#### **量化及衍生品投资部**

负责公司公募、专户理财及其他委托投资业务的数量化及衍生品的研究和投资等相关业务。

#### **固定收益部**

负责公司固定收益证券的研究、投资工作。

#### **研究部**

责行业及上市公司研究，在公司既定的投资理念和研究理念的基础上，以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持工作。

#### **集中交易室**

负责执行公司既定的各基金的投资指令并及时反馈市场信息。

### **国际业务部**

负责 QDII 基金海外投资研究和 QFII 业务开拓，进行相关国际业务产品研究分析。

### **投资银行部**

负责公司新三板和股权投资基金等相关业务工作。

### **产品规划部**

负责制定公司产品规划与发展策略以及产品设计、产品管理和产品研究工作，完善公司产品线，丰富公司产品储备。

### **监察稽核部**

负责公司各项制度、业务的合法合规性审核，对公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，以及采用定量分析的手段，对公司管理的各种资产组合的投资收益进行风险和绩效评估。

### **总裁办公室**

负责公司财务管理、日常行政事务管理。

### **人力资源部**

负责公司人力资源管理工作。

### **登记结算部**

负责安全高效地完成资产组合的估值，注册登记及资金清算业务，保障后台运作正常运行。

### **信息技术部**

负责公司信息技术系统开发、运行和维护，为公司战略和业务发展提供全面、及时、可靠的信息技术支持。

### **市场发展部**

负责贯彻公司管理层的战略规划，组织基金销售工作，进行渠道管理以及客户服务工作。

### **营销策划部**

负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持等各项职能工作。

### **机构理财部**

负责开展公募基金直销、专户理财、社保、企业年金等各项业务的营销和服务工作。

### **电子商务部**

负责公司电子商务平台的搭建、业务推广和公司网站的建设、更新、内容维护，以及第三方销售机构的渠道管理工作。

### **渠道业务部**

负责公司券商渠道销售管理及服务工作。

### **北京分公司**

主要负责北方地区的基金销售业务。

#### 上海分公司

主要负责华东区域的基金销售业务。

#### 武汉分公司

主要负责华中区域的基金销售业务。

#### 广州分公司

主要负责华南区域的基金销售业务。

#### 鹏华资产管理（深圳）有限公司

负责特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务

#### 12、人员情况

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共有员工 300 人，其中，博士占比 3.7%，硕士占比 62%，本科占比 31%，其他占比 3.3%。

#### 13、信息披露负责人及咨询电话

张戈 0755-82825720

#### 14、本基金基金经理

叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，8 年金融证券从业经验。曾任职于招商银行总行，从事本外币资金管理相关工作；2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事货币基金管理工作，2014 年 2 月担任鹏华增值宝货币基金基金经理，2015 年 1 月起兼任鹏华安盈宝货币基金基金经理，2015 年 7 月起兼任鹏华添利宝货币基金基金经理，2016 年 1 月起兼任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理。叶朝明先生具备基金从业资格。

### （二）基金托管人

#### 一、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

成立时间：1984 年 1 月 1 日

注册资本：人民币 349,321,234,595 元

法定代表人：姜建清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：蒋松云

#### 二、主要人员情况

截至 2015 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 205 人，平均年龄 30 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2015 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 496 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### （三）登记机构

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：周明  
联系电话：010-50938856  
传真：010-50938907  
联系人：崔巍

### （四）验资机构

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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
法定代表人：杨绍信  
联系电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：单峰、魏佳亮

## 12、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

### 13、 基金财务状况

#### (一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用, 不从基金资产中支付。

#### (二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

#### (三) 基金资产负债表

本基金 2016 年 2 月 15 日资产负债表如下:

资 产	2016 年 2 月 15 日 余额	负债和所有者权益	2016 年 2 月 15 日 余额
资 产：		负债：	
银行存款	1,440,595,148.55	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	177,209.02
基金投资		应付托管费	53,162.67
衍生金融资产		应付销售服务费	147,674.20
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	2,337,411.63	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	14,644.98
其他资产		负债合计	392,690.87
		所有者权益：	
		实收基金	1,442,539,869.31
		未分配利润	
		所有者权益合计	1,442,539,869.31
资产合计	1,442,932,560.18	负债与持有人权益总计：	1,442,932,560.18

### 14、 基金投资组合

截止到 2016 年 2 月 15 日, 本基金的投资组合如下:

#### (一) 基金资产组合情况

资产类别	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)

1	股票	-	-
2	基金	-	-
3	债券	-	-
4	其中：央票	-	-
5	国债	-	-
6	政策性金融债	-	-
7	金融债（商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券）	-	-
8	企业债	-	-
9	企业短期融资券	-	-
10	可转债	-	-
11	权证	-	-
12	资产支持证券	-	-
13	货币市场工具（票据、CD）	-	-
14	现金（银行存款及清算备付金）	13,595,148.55	0.94
15	银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单）	1,427,000,000.00	98.90
16	其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等）	2,337,411.63	0.16
17	其中：买入返售证券	-	-
18	资产合计	1,442,932,560.18	100.00

**（二）报告期债券回购融资情况**

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

**债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明**

注：本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

**(三) 基金投资组合平均剩余期限****1. 投资组合平均剩余期限基本情况**

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

**报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明**

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。本基金合同约定：“本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. 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	57.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	20.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	18.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	4.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.87	-

**(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

**(五) 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**

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

**(六) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离**

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**(八) 投资组合报告附注****1.基金计价方法说明**

- (1) 基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；
- (2) 基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；
- (3) 基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；
- (4) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；
- (5) 基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

**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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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	2,337,411.63
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,337,411.63



## 5.投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金的投资决策流程主要包括：久期决策、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。其中久期区间决策由投资决策委员会负责制定，基金经理在设定的区间内根据市场情况自行调整；期限结构配置和类属配置决策由固定收益小组讨论确定，由基金经理实施该决策并选择相应的个券进行投资。

2、由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 15、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

### 16、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

### 17、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将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将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限

期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

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

## 18、 基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 19、 备查文件目录

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》
- 3、《鹏华添利交易型货币市场基金托管协议》
- 4、《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照

### （二）存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

### （三）查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司

二〇一六年二月十七日

**附件：鹏华添利交易型货币市场基金基金合同摘要**

**一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务**

**(一) 基金份额持有人的权利、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) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者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》；
- (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、申购款项或对价及法律法规和《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。

**(二) 基金管理人的权利、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) 依法募集资金;
  - (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规定或中国证监会批准的其他费用;
  - (4) 销售基金份额;
  - (5) 按照规定召集基金份额持有人大会;
  - (6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定, 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, 对基金销售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》及有关法律的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与赎回申请;
  - (12) 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、融券及转融通;
  - (13) 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;
  - (14) 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;
  - (15) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;
  - (16) 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) 依法募集资金, 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基金资产净值,各类基金份额的每万份或者每百份基金已实现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、足额支付赎回对价;

(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内发出,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，基金管理人承担全部募集费用，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。

### (三) 基金托管人的权利、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) 建立健全内部风险控制、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和证券账户,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基金资产净值、基金份额的每万份或者每百份基金已实现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对价；

(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定；

(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召集、议事及表决的程序和规则

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。由于 A 类基金份额的面值为 1 元，B 类基金份额在基金合同生效日折算后的面值为 100 元，因此在本部分中，在计算包括但不限于提议召开基金份额持有人大会、参加基金份额持有人大会以及基金份额持有人大会提案和表决等事项的基金份额持有人所持有的基金份额和基金总份额时，每 100 份 A 类基金份额等同于 1 份 B 类基金份额。基金份额持有人持有的同一类别内的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。

### (一) 召开事由

1、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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (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) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《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、以下情况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) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；



- (3) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调低基金的销售服务费率或变更收费方式；
- (4) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置；
- (5) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对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、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；
- (6) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；
- (7) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (8) 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重大变化；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 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开时，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。

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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三) 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 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。

(四) 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、通讯开会方式或法律法规和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二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 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在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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收取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收取书面表决意见的，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，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 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应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(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，并与基金登记注册机构记录相符；

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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七条规定程序确定和公布监票人，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二分之一以上（含二分之一）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。

#### （六）表决

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二分

之一以上（含二分之一）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。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表决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，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。

#### （七）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监督员共同担任监票人；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监票人。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）监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怀疑，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。监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）计票过程应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监督员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。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 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。

（九）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的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

#### （二）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 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、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- 4、场外“每日分配、按日支付”。本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付。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；若投资人在当日收益支付时，其当日净收益为正值，则为投资

人增加相应的基金份额，其当日净收益为零，则保持投资人基金份额不变，基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额。若基金份额持有人赎回基金份额，当基金份额持有人全部赎回基金份额时，基金收益将立即结算并随赎回款项一起支付给投资者，如果基金收益为负，则扣减赎回金额；当基金份额持有人部分赎回基金份额时，不结算基金收益，若收益为负值且剩余的基金份额不足以弥补时，将自动按比例结转基金份额当前未付收益；基金管理人有权通过销售机构或自行向基金份额持有人追索，基金份额持有人应予支付；

5、本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，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。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；

6、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；

7、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；

8、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

9、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

本基金按日计算并分配收益，基金管理人另行公告基金收益分配方案。

### （四）收益分配的时间和程序

本基金每日进行收益分配。每个开放日公告前一个开放日每万份或每百份基金已实现收益和 7 日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的每万份或每百份基金已实现收益和节假日最后一日的 7 日年化收益率，以及节假日后首个开放日的每万份或每百份基金已实现收益和 7 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。

本基金每日例行的收益结转不再另行公告。

（五）本基金基金份额每万份或每百份基金已实现收益及 7 日年化收益率的计算见本基金合同“基金的信息披露”章节。

## 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

### （一）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 2 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、公休假等，支付日期顺延。

### （二）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 0.09% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.09\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 2 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。

### （三）基金销售服务费

本基金的年销售服务费率为 0.25%，基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

### （一）投资目标

在严格控制风险和保持流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。

### （二）投资范围

本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券（包括



超级短期融资券), 一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单等银行存款, 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、中期票据以及资产支持证券, 期限在一年以内(含一年)的债券回购和中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

未来若法律法规或监管机构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、不改变基金风险收益特征的前提下, 本基金可参与投资, 不需召开基金份额持有人大会, 具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他产品, 基金管理人在履行适当的程序后, 可以将其纳入投资范围。

### (三) 投资限制

#### 1、组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

- (1) 本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) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的 10%;
- (3) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%, 根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款, 不受此限制;
- (4) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%;
- (5) 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;
- (6) 本基金的存款银行须为具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。本基金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%;
- (7) 本基金持有一家公司发行的证券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%;
- (8) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例, 合计不得超过基金资产净值的 10%;
- (9) 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%；

(10) 除发生巨额赎回的情形外，本基金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%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整；

(11) 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(12) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(13) 中国证监会规定的其他比例限制。

除上述第(10)条外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内调整完毕，以达到上述标准，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效日起 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，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。

法律法规或监管部门调整上述限制，则本基金投资将按照调整后的规则执行。

2、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应具备下列条件之一：

1) 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；

2) 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）。

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。

本基金持有的短期融资券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个交易日内对其予以全部减持。

法律法规或监管部门调整上述限制，则本基金投资将按照调整后的规则执行。

3、本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。

本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 3 个月内对其予以全部卖出。

法律法规或监管部门调整上述限制，则本基金投资将按照调整后的规则执行。

4、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票和权证；
- (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；
- (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) 流通受限证券；
- (8) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。

如果法律法规对上述投资范围、投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

法律法规或监管部门取消上述限制，则本基金投资不再受相关限制。

5、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) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程

序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）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。

### （二）基金资产净值、每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、A 类基金份额每万份基金已实现收益、B 类基金份额每百份基金已实现收益和 7 日年化收益率；

（1）A 类基金份额每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率的计算方法如下：

日每万份基金已实现收益 = 当日基金份额的已实现收益 / 当日基金份额总额 × 10000

7 日年化收益率的计算方法：

7 日年化收益率以最近七个自然日的每万份基金已实现收益按每日复利折算出的年收益率。计算公式为：

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

其中， $R_i$  为最近第  $i$  个自然日(包括计算当日)的每万份基金已实现收益。

（2）B 类基金份额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：

日每百份基金已实现收益 = 当日基金份额的已实现收益 / 当日基金份额总额 × 100

其中，当日该类基金份额总额包括截至上一工作日（包括节假日）未结转份额。

7 日年化收益率的计算方法：

7 日年化收益率以最近七个自然日的每百份基金已实现收益按每日复利折算出的年收益率。计算公式为：

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

其中， $R_i$  为最近第  $i$  个自然日(包括计算当日)的每百份基金已实现收益。

每万份基金已实现收益和每百份基金已实现收益采用四舍五入保留至小数点后第 4 位，7 日年化收益率采用四舍五入保留至百分号内小数点后第 3 位。如果基金成立不足七日，按类似规则计算。

2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率。

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值、每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率登载在指定媒介上。

## 七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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生效后方可执行，并自决议生效之日起在指定媒介公告。

### （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、基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、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) 《基金合同》终止情形出现时，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) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

**八、争议解决方式**

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，如经友好协商未能解决的，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，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

**九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《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。