

华泰柏瑞基金管理有限公司

华泰柏瑞交易型货币市场基金

更新的招募说明书

2016年第1号

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一六年二月

# 华泰柏瑞交易型货币市场基金招募说明书

## 重要提示（更新）

华泰柏瑞交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）根据 2014 年 9 月 9 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞交易型货币市场基金注册的批复》（证监许可【2014】936 号）的注册，并根据 2015 年 5 月 28 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞交易型货币市场基金延期募集备案的回函》（机构部函【2015】1583 号）进行募集。本基金的基金合同于 2015 年 7 月 14 日正式生效。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书在中国证监会注册，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。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者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基金管理风险、本基金的特定风险等等。另外，本基金在上海证券交易所上市交易，对于选择买卖的投资人而言，交易费用和二级市场流动性等因素都会在一定程度上影响投资人的投资收益，由于货币基金的每日收益有限，交易费用会降低投资人的投资收益；另外，二级市场的价格受供需关系的影响，可能高于或低于基金的份额净值，形成溢价交易或折价交易。当溢价交易时，买入份额的投资人以高于面值的价格买入本基金，投资收益减少，而卖出份额的投资人以高于面值的价格卖出本基金，投资收益增加；当折价交易时，买入份额的投资人以低于面值的价格买入本基金，投资收益增加，而卖出份额的投资人以低于面值的价格卖出本基金，投资收益减少。由于上海证券交易所可根据基金管理人的要求对本基金当日的赎回申请进行总量控制，所以投资人可能面临无法及时赎回本基金的风险。

在目前结算规则下，T 日买入的基金份额，当日可卖出和赎回；T 日申购的基金份额，T+2 日可卖出和赎回。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2016 年 1 月 13 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2015 年 12 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

## 目 录

一	绪言 .....	1
二	释义 .....	2
三	基金管理人 .....	5
四	基金托管人 .....	12
五	相关服务机构.....	16
六	基金的募集 .....	28
七	基金合同的生效.....	31
八	基金份额的折算.....	32
九	基金份额的上市.....	33
十	基金份额的申购与赎回.....	34
十一	基金的投资 .....	38
十二	基金的业绩 .....	47
十三	基金的财产 .....	48
十四	基金资产估值 .....	50
十五	基金的收益与分配 .....	54
十六	基金的费用与税收 .....	56
十七	基金的会计与审计 .....	58
十八	基金的信息披露 .....	59
十九	基金的风险揭示 .....	64
二十	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	67
二十一	基金合同的内容摘要 .....	69
二十二	基金托管协议的内容摘要 .....	81
二十三	对基金份额持有人的服务 .....	93
二十四	其他应披露事项 .....	94
二十五	招募说明书存放及查阅方式 .....	95
二十六	备查文件 .....	96

## 一 绪言

本招募说明书依据《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》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《华泰柏瑞交易型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，并在中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，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，并按照《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。

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并在中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

## 二 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指华泰柏瑞交易型货币市场基金
- 2、基金管理人：指华泰柏瑞基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《华泰柏瑞交易型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《华泰柏瑞交易型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《华泰柏瑞交易型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《华泰柏瑞交易型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
- 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 3 月 15 日颁布、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：指基金管理人或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、赎回等业务

22、销售机构：指华泰柏瑞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服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

23、注册登记业务：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的建立和管理、基金份额注册登记、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等

24、注册登记机构：指中国证券登记结算有限责任公司

25、证券账户：指中国证券登记结算有限责任公司上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户

26、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

27、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

28、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

29、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

30、工作日：指上海证券交易所的正常交易日

31、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

32、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)，n为自然数

33、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

34、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

35、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

36、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

37、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

38、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

39、基金份额折算：基金合同生效后，基金管理人根据基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为

40、上市交易：指基金合同生效后，基金管理人根据规定向上海证券交易所申请基金份

额的上市。申请成功后，投资者可在上海证券交易所进行本基金份额的买入和卖出操作

41、元：指人民币元

42、基金收益：指基金投资所得债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、银行存款利息和其他收入，因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益

43、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

44、每百份基金已实现收益：指按照相关法规计算的每百份基金份额的日已实现收益

45、七日年化收益率：指以最近七日(含节假日)收益所折算的年资产收益率

46、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

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

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

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

51、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

52、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件



### 三 基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：齐亮

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：汪莹白

联系电话：400-888-0001, (021) 38601777

股权结构：柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998 年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001 年任中央财经领导小组办公室副局长，2001 年至 2004 年任华泰证券股份有限公司副总裁。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司，华之杰国际商业顾问有限公司，1992 年 4 月至 1996 年 12 月任 AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理，1997 年 1 月至 2001 年 7 月任 AIG 友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理，2001 年 7 月至 2010 年 2 月任 AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理，2010 年 2 月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992 年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

Rajeev Mittal 先生：董事，学士，1992 年加入美国国际集团，2009—2011 年担任柏瑞投资（欧洲分公司）总经理，新兴市场投资主管，全球固定收益研究团队主管和行政总裁（欧洲分公司），2011 年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁（亚洲，日本除外）、总经理、新兴市场投资总管，全球固定收益研究团队主管。

韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券

监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

朱小平先生，独立董事，硕士，1983至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生，独立董事，1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生，独立董事，博士，1988-1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，1997-1999年任长城证券有限公司投资银行部副总经理，1999-2000年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理，2000-2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，2001年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

杨科先生：独立董事，学士，2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合伙人。

## 2、监事会成员

严玉珍女士：监事，学士，1987年1月至1988年9月任罗兵咸永道（前容永道会计）高级稽核员，1988年12月至1990年4月任香港电讯（前大东电报）管理会计，1990年5月至1996年11月任宝达证券（施罗德集团）副财务总监，1996年12月至2007年9月任施罗德投资管理（香港）有限公司财务董事，2007年9月至2008年6月任交银施罗德基金管理有限公司高级总经理顾问，2008年7月至2012年9月任施罗德投资管理（香港）有限公司首席营运官，2012年9月至今任柏瑞投资亚洲有限公司首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金经理，2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500ETF及华泰柏瑞中证500ETF联接基金的基金经理。

童辉先生：监事，硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任信息技术与电子商务部总监。

## 3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999 年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004 年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001 年就职于上海证券交易所登记结算公司，2001-2004 年任华安基金管理有限公司部门总监，2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士：副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司 (BGI) 担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月起任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA 毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

高山先生，副总经理，博士。2001 年 5 月至 2013 年 7 月任职于全国社会保障基金理事会投资部，任处长；2013 年 7 月起加入华泰柏瑞基金管理有限公司。本科毕业于山东大学经济管理学院，硕士毕业于中国人民银行研究生部，博士毕业于财政部财政科学研究所研究生部。

董元星先生，副总经理，博士。2006.9-2008.12 任巴克莱资本（纽约）债券交易员，2009.3-2012.8 任华夏基金管理有限公司基金经理。2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部总监。2013 年 10 月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 2 月起任总经理助理。2015 年 12 月起任公司副总经理。北京大学经济学学士，纽约大学 STERN 商学院金融学博士。

程安至先生，副总经理，硕士。1997.9-2001.1 任中国工商银行上海市分行信贷经理，2001.2-2012.4 任华安基金管理有限公司市场部销售总监。2012 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任总经理助理。2015 年 12 月起任公司副总经理。本科毕业于华东师范大学国际金融专业，硕士毕业于上海财经大学国民经济学专业，EMBA 毕业于上海交通大学中欧国际工商学院。

#### 4、本基金基金经理

郑青女士，10 年证券（基金）从业经验，经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司，2008 年 3 月至 2010 年 4 月任中海基金管理有限公司交易员，2010 年加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任债券研究员。2012 年 6 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理，2013 年 7 月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基

金经理。2015年1月起任固定收益部副总监。2015年7月起任华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理高山先生；副总经理田汉卿女士；副总经理兼固定收益部总监董元星先生；投资部总监方伦煜先生；投资部总监吕慧建先生。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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财产分别管理、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，确定基金份额申购、赎回价格；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

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、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；

13、中国证监会规定的其它职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、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，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、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财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (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，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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，泄露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；
- (8) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 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，泄露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) 不从事损害基金财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、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

(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。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

(5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

(6) 成本效益原则。公司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。

## 2、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### (2) 风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

### (3) 控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科

学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

- （1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- （2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年 6 月末，本集团资产总额 182,192 亿元，较上年末增长 8.81%；客户贷款和垫款总额 101,571 亿元，增长 7.20%；客户存款总额 136,970 亿元，增长 6.19%。净利润 1,322 亿元，同比增长 0.97%；营业收入 3,110 亿元，同比增长 8.34%，其中，利息净收入同比增长 6.31%，手续费及佣金净收入同比增长 5.76%。成本收入比 23.23%，同比下降 0.94 个百分点。资本充足率 14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到 1.44 万个，综合营销团队达到 19,934 个、综合柜员占比达到 84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 94.32%，较上年末提高 6.29 个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长 8.19%、10.78%和 11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015 年 6 月末，累计承销非金融企业债务融资工具 2,374.76 亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业



中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数 3,076 万户，管理资金总额 7,417.41 亿元，均为行业第一。

2015 年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的 40 多项重要奖项。在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《福布斯》杂志 2015 年全球上市公司 2000 强排名中继续位列第 2；在美国《财富》杂志 2015 年世界 500 强排名第 29 位，较上年上升 9 位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015 年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 210 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前

国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2015 年末，中国建设银行已托管 556 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内

容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五 相关服务机构

### (一) 一级代办券商

#### 1) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：(0755) 82825551

传真：(0755) 82558355

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

#### 2) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市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：王春峰

联系人：王星

电话：(022) 28451922

传真：(022) 28451892

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

#### 3) 财达证券有限责任公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 至 26 层

法定代表人：翟建强

联系人：胡士光

电话：(0311) 66006403

传真：(0311) 66006249

客服电话：400-612-8888

公司网址：www.s10000.com

#### 4) 长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：(0755) 83516094

传真：(0755) 83515567

客服电话：(0755) 33680000、400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

5) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

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：胡运钊

联系人：奚博宇

电话：(021) 68751860

传真：(021) 68751151

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

6) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市福山路500号26楼

办公地址：上海市福山路500号26楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767981

客服电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

7) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

电话：(0755) 23838751

传真：(0755) 23838750

客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

8) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路 1138 号  
法定代表人：矫正中  
联系人：安岩岩  
电话：(0431) 85096517  
传真：(0431) 85096795  
客服电话：4006000686, (0431) 85096733  
公司网址：www.nesc.cn

9) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层  
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦  
法定代表人：朱科敏  
联系人：王一彦  
电话：021-20333333  
传真：021-50498825  
客服电话：95531 或 400-8888-588  
公司网址：www.longone.com.cn

10) 东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号  
办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号  
法定代表人：吴永敏  
联系人：方晓丹  
电话：(0512) 65581136  
传真：(0512) 65588021  
客服电话：400-860-1555 或 96288  
公司网址：www.dwzq.com.cn

11) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层  
办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层  
法定代表人：徐勇力  
联系人：汤漫川  
电话：(010) 66555316  
传真：(010) 66555246  
客服电话：400-888-8993  
公司网址：www.dxzq.net

## 12) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：(0731) 85832503

传真：(0731) 85832214

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

## 13) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

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：周洁瑾

电话：(021) 22169999

传真：(021) 22169134

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

## 14) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广州市天河北路183号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、

43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87555305

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

## 15) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

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) 84183333

传真：(010) 84183311-3389

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

16) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：(028) 86690057

传真：(028) 86690126

客服电话：4006-600109

公司网址：www.gjzq.com.cn

17) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：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 层

法定代表人：万建华

联系人：芮敏棋

电话：(021) 38676666

传真：(021) 38670666

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

18) 国信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

19) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号



法定代表人：庞介民

联系人：扬子莹

电话：(0471) 4974437

客服电话：(0471) 4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

20) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼  
2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 楼

法定代表人：李季

联系人：王君

电话：0991-7885083

传真：0991-2301802

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.swhysc.com

21) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：68778790

传真：68777992

客服电话：4008209898

公司网址：www.cnhbstock.com

22) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：徐松梅

电话：(0591) 83893286

传真：(0591) 87383610

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

23) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号  
办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
法定代表人：吴万善  
联系人：庞晓云  
电话：(0755) 82569143  
传真：(0755) 82492962  
客服电话：95597  
公司网址：www.htsc.com.cn

24) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元  
办公地址：上海市肇家浜路 750 号  
法定代表人：俞洋  
联系人：陈敏  
电话：(021) 64316642  
传真：(021) 64333051  
客服电话：400-109-9918、021-32109999、029-68918888  
公司网址：www.cfsc.com.cn

25) 平安证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼  
办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼 8 楼  
法定代表人：杨宇翔  
联系人：吴琼  
电话：(0755) 22621866  
传真：(0755) 82400862  
客服电话：95511\*8  
公司网址：stock.pingan.com

26) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号  
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：021-53686100，021-53686200  
客服电话：021-962518

公司网址: [www.962518.com](http://www.962518.com)

27) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

联系人: 黄莹

电话: (021) 33389888

传真: (021) 33388224

客服电话: 95523 或 4008895523

公司网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

28) 万联证券有限责任公司

注册地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址: 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人: 张建军

联系人: 甘蕾

电话: (020) 38286026

传真: (020) 37865008

客服电话: 400-888-8133

公司网址: [www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

29) 西南证券股份有限公司

注册地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址: 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人: 余维佳

联系人: 张煜

电话: (023) 63786141

传真: (023) 63810422

客服电话: 400-809-6096

公司网址: [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

30) 湘财证券有限责任公司

注册地址: 湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址: 湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人: 林俊波

联系人: 钟康莺

电话: (021) 68634518

传真：(021) 68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

31) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

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：张志刚

联系人：尹旭航

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

32) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

电话：(0591) 38281963

客服电话：400-888-8123

公司网址：www.xyzq.com.cn

33) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人：吴承根

联系人：张梦莹

电话：(021) 64718888

传真：(0571) 87901913

客服电话：(0571) 95345

公司网址：www.stocke.com.cn

34) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层

法定代表人：丁学东

联系人：罗文雯

电话：(021) 58763575  
传真：(021) 68875123  
客服电话：(021) 58796226-3736  
公司网址：www.cicc.com.cn

35) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

电话：(0755) 82023442

传真：(0755) 82026539

客服电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

36) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市安立路 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：400-8888-108

传真：(010) 65182261

客服电话：400-888-8108

公司网址：www.csc108.com

37) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层(266061)

法定代表人：杨宝林

联系人：赵艳青

电话：(0532) 85022326

传真：(0532) 85022605

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

38) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：(010) 60838888

传真：(010) 60833739

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

39) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳、范春艳

电话：(0371) 69099882

传真：(0371) 65585899

客服电话：95377

公司网址：www.ccnew.com

40) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：范超

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客服电话：400-809-6518（全国） 96518（安徽）

公司网址：www.hazq.com

41) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客服电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

## 42) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元

法定代表人：李长伟

联系人：唐昌田

电话：010-88321717

传真：010-88321763

客服电话：400-665-0999

公司网址：www.tpyzq.com

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## (二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：中国北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：4008-058-058

## (三) 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：刘佳、范佳斐

## (四) 会计师事务所和经办注册会计师

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

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、刘颖

电话：021-23238888

传真：021-23238800

## 六 基金的募集

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，并于 2014 年 9 月 9 日在中国证监会《关于准予华泰柏瑞交易型货币市场基金注册的批复》（证监许可【2014】1583 号），并根据 2015 年 5 月 28 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞交易型货币市场基金延期募集备案的回函》（机构部函【2015】1583 号）注册募集。

### （一）场内简称及代码

场内简称：华泰货币

认购代码：511833

申购赎回代码：511831

二级交易代码：511830

### （二）基金类型

货币市场基金

### （三）基金存续期

不定期

### （四）基金运作方式

契约型开放式

### （五）募集方式

投资人可通过网上现金认购方式认购本基金。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的销售机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。

### （六）募集期限

本基金自 2015 年 7 月 2 日至 2015 年 7 月 6 日公开发售。根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可继续销售，但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售。本基金的实际发售时间为 2015 年 7 月 2 日至 2015 年 7 月 6 日。

### （七）募集对象

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）募集规模

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额应不少于 2 亿元人民币。

### （九）基金的面值



本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，以初始面值发售。

#### （十）投资人对基金份额的认购

##### 1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在发售公告中确定并披露。

##### 2、认购的方式及确认

（1）本基金认购采取份额认购、全额缴款方式。

（2）销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，且仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

（3）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

（4）若投资者的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

##### 3、认购的限额

（1）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

（2）在基金募集期内，投资者通过销售机构首次认购本基金单笔最低份额为 1,000 份，追加认购的单笔最低份额为 1,000 份。

各销售机构对最低认购份额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

##### 4、认购费率

本基金不收取认购费。

##### 5、认购金额的计算

认购金额=认购份额×基金份额初始面值

例：某投资者投资 10,000 份认购本基金份额，假设该笔认购按照 100%的比例全部予以确认，则其可得到的基金份额计算如下：

认购金额=10,000×1.00=10,000 元

#### （十一）募集资金及利息的处理

1、基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

2、有效认购资金在募集期形成的利息计入基金资产。

#### （十二）募集结果

本基金募集工作已于 2015 年 7 月 13 日顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 701,619,000.00 元人民币，折合基金份额 701,619,000.00 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 110,246.90 元人

人民币，折合基金份额 110,246.90 份。本次募集的场内资金和场外资金已均于 2015 年 7 月 10 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。本次募集有效认购户数为 4,920 户，按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金结转的基金份额共计 701,619,000.00 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有，认购资金产生利息结转的基金份额共计 110,246.90 份，计入基金资产，不折算为投资人基金份额。按照有关法律规定，本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。根据《基金法》、《运作管理办法》和《基金合同》、《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完毕基金备案手续，并于 2015 年 7 月 14 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 七 基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

### （二）基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### （三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

### （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同存续期内，连续 20 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 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 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，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 八 基金份额的折算

### （一）基金份额折算的时间

基金合同生效后，基金管理人办理基金份额折算。

### （二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人办理，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。

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，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

### （三）基金份额折算的方法

折算后基金份额持有人持有的基金份额=折算前基金份额持有人持有的基金份额/100

折算后每份基金份额对应的面值为 100 元。

## 九 基金份额的上市

### （一）基金份额的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请上市：

- 1、基金募集金额不低于 2 亿元；
- 2、基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

### （二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《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

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份额的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本部分第一款规定的上市条件；
- 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份额终止上市交易公告。

## 十 基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将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）申购和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、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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或者赎回。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受的，视为下一开放日的申购、赎回。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、“确定价”原则，即申购、赎回价格以每份基金份额净值为基准进行计算；
- 2、“份额申购、份额赎回”原则，即申购以份额申请，赎回以份额申请；
- 3、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
- 4、本基金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。投资人赎回基金份额时，其对应比例的累积收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除；
- 5、当日的申购、赎回申请在当日基金交易时间内提交后不得撤销。

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

则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （四）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，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项的，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购款项在规定时间内未全额到账，则申购不成立。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则提交的赎回申请不成立。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以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，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后(包括该日)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。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

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、赎回的确认以注册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。

#### （五）申购和赎回的数量限制

1、本基金申购和赎回的份额必须为 1 份或 1 份的整数倍。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 10 份时，余额部分必须一同赎回。

2、上海证券交易所可根据基金管理人的要求对当日的赎回申请进行总量控制。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

本基金不收取申购费用和赎回费用。

### （七）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运行。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 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、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、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。
- 6、上海证券交易所、销售机构、注册登记机构等因异常情况无法办理申购的情况。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在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。

### （八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的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，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 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、当日超出基金管理人规定的总量控制的赎回申请。
- 5、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 6、上海证券交易所、销售机构、注册登记机构等因异常情况无法办理赎回的情形。
- 7、基金在开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。
- 8、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9 项暂停赎回的情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 7 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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。

### （九）巨额赎回的情形及处理方式

- 1、巨额赎回的认定



若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延缓支付赎回款项。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延缓支付部分赎回款项，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，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付。但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种指定媒介上予以公告。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请，并应当在指定媒介上进行公告。

### (十) 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、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，按照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

### (十一) 基金的非交易过户、冻结和解冻

注册机构登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

## 十一 基金的投资

### （一）投资目标

在力争保持基金资产安全和高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的稳健投资收益。

### （二）投资范围

本基金投资于以下金融工具：现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单等银行存款、期限在1年以内（含1年）的债券回购、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、中期票据、资产支持证券等债券品种，以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

本基金将采用主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资，在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，获得稳健的投资收益。

1、利率预期策略：本基金将首先采用利率预期策略（Interest-Rate Expectation Strategy），通过利率分析系统，综合研究国内外宏观经济趋势、财政及货币政策导向、短期资金的供求状况等因素从而对货币市场利率走势进行预测。根据对未来利率走势的科学预测最终形成投资组合的平均剩余期限，若预测未来利率将上升，则降低投资组合的平均剩余期限，反之，则增加投资组合的平均剩余期限。本基金的平均剩余期限将控制在120天之内。

2、估值中枢策略：运用不同品种的收益率曲线预测模型，对货币市场工具进行合理估值，确定价格中枢的变动趋势。综合考虑基金资产组合的流动性、收益率、风险等因素以及债券的估值原则，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化作相应调整。

3、类属配置策略：在保持组合资产相对稳定的条件下，本基金在实际操作中主要依据各类短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境，决定不同类属的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别品种的具体资产配置比例。

4、流动性管理策略：本基金将在动态测算基金投资者净赎回资金需求、季节性资金流动等因素的前提下，对基金资产进行合理配置，通过实时追踪基金资产的现金库存、资产变现能力等因素，合理配置和动态调整组合现金流，在保持基金财产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益，结合持续性投资的方法，将各类属资产的到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。

### （四）投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；
- 2、根据投研团队对于市场中可获得相应数据的研究分析所构建的投资模型以及投资经理和投研团队对市场状态的判断；
- 3、基于风险估测模型的投资风险分析。

#### （五）投资决策机制

1、投资决策委员会负责审定基金经理的投资策略和原则；审定基金经理定期调整计划；审定基金定期投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

2、基金经理：在投资决策委员会的授权范围内，根据基金的投资政策实施投资管理，确定具体的投资品种、数量、策略，构建优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理工作。

3、基金经理助理/投资分析员：通过内部调研和参考外部研究报告，编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告，提交基金经理，作为投资决策的依据。

#### （六）投资程序

1、投研团队对市场中可获得的相应数据进行研究分析，并构建投资模型，为本基金的投资管理提供决策依据。

2、投资决策委员会依据投研团队的研究结果对基金的资产配置比例等提出指导性意见。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，利用投资模型，并结合对宏观政策、证券市场等的分析判断，形成基金投资计划。

4、集中交易室依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、法律监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

#### （七）投资限制

##### 1、组合限制

（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、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制后，基金管理人履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

(2) 本基金的投资组合将遵循以下比例限制：

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) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过该证券的 10%；  
3) 基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过该证券的 10%  
4) 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%，据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制；

5) 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%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；

6) 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；

7) 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%；

8) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

9) 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%；

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%；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%；

11) 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 个工作日内进行调整；

12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

13) 中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

除上述第 11) 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 个工作日内进行调整，以达到上述标准。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，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本基金合同生效之日起开始。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的, 以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制, 且适用于本基金, 经履行适当程序后, 本基金投资不再受相关限制, 但须提前公告, 不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定, 如法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 则本基金投资不再受相关限制; 基金管理人应提前三个交易日公告, 此调整无需召开基金份额持有人大会。

3、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。

### （八）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为当期银行活期存款利率（税后）。

基金管理人在合理的市场化利率基金推出的情况下，可根据投资目标、投资方向和投资策略，确定变更业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人应在调整前在至少一种指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。

### （九）风险收益特征

本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### （十）投资组合平均剩余期限计算方法

#### 1、计算公式

本基金按下列公式计算平均剩余期限：

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

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、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）的正回购、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方法

（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。

（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。

（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。

(十一) 基金管理人代表行使权力的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值；

2、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力，保护基金份额持有人的利益。

(十二) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规的规定进行融资、融券。

(十三) 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2015 年 12 月 31 日。

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	1,631,518,954.57	45.40
	其中：债券	1,631,518,954.57	45.40
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	478,901,918.35	13.33
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,471,460,924.94	40.94
4	其他资产	11,994,326.50	0.33
5	合计	3,593,876,124.36	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	11.57	
	其中：买断式回购融资	0.00	
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	228,687,366.96	6.80
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：在本报告期内本基金债券正回购的基金余额未超过资产净值的 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	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

#### (2) 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

#### (3) 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	33.01	6.80
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	8.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	34.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	14.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	15.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.49	6.80

### 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	99,836,703.97	2.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,023,559.72	2.97
	其中：政策性金融债	100,023,559.72	2.97
4	企业债券	-	-



5	企业短期融资券	1,431,658,690.88	42.56
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,631,518,954.57	48.51
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	011599668	15舟交投SCP001	1,000,000	100,350,581.17	2.98
2	011599926	15重汽SCP007	1,000,000	100,294,894.55	2.98
3	011599650	15津保税SCP005	1,000,000	100,209,449.72	2.98
4	041555046	15闽投CP001	1,000,000	100,193,557.85	2.98
5	041557005	15中色CP002	1,000,000	100,145,454.50	2.98
6	071530007	15财通证券CP007	1,000,000	99,995,294.65	2.97
7	011599904	15金隅SCP003	1,000,000	99,993,737.16	2.97
8	071507007	15中信建投CP007	1,000,000	99,986,117.54	2.97
9	011548003	15中节能SCP003	1,000,000	99,958,484.43	2.97
10	159914	15贴现国债14	700,000	69,867,142.63	2.08

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1299%
报告期内偏离度的最低值	0.0166%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均	0.0778%

值	
---	--

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

8、投资组合报告附注

(1)

本基金计价采用摊余成本法，即计价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，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币 100.00 元。

(2)

本基金本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

(3) 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

(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	11,994,326.50
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,994,326.50

## 十二 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2015 年 12 月 31 日。

### 1、 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月（2015年10月1日—2015年12月31日）	0.7700%	0.0052%	0.0894%	0.0000%	0.6806%	0.0052%
成立至今（2015年7月14日—2015年12月31日）	1.2414%	0.0041%	0.1663%	0.0000%	1.0751%	0.0041%

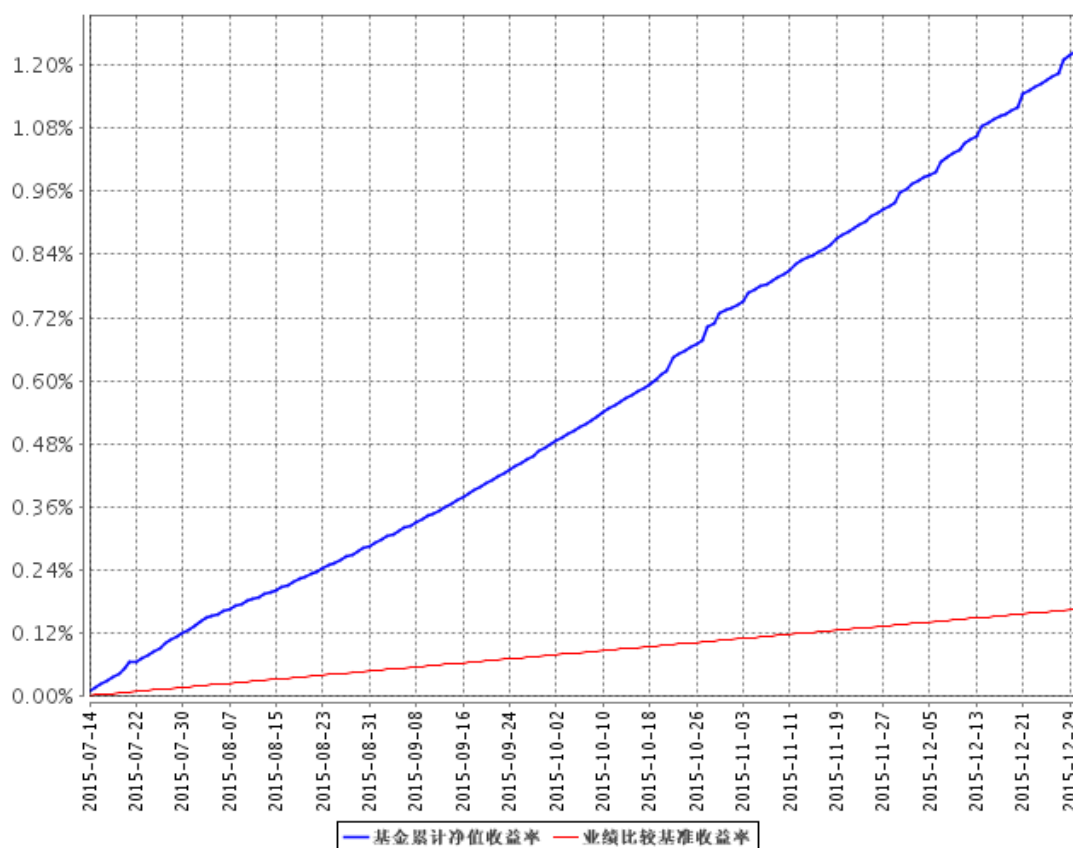
### 2、 基金的收益分配情况

本基金成立以来未进行收益分配。

### 3、 图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

基金份额累计净值增长率变动及其与业绩比较基准收益率历史走势对比图

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



注：1. 图示日期为 2015 年 7 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日。

### 十三 基金的财产

#### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

#### (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

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。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注册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、基金注册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 基金资产估值

### （一）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营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （二）估值对象

基金所拥有的各类证券和银行存款本息、备付金、保证金及其他资产和所承担的金融负债。

### （三）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。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。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

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，同时基金管理人应编制并披露临时报告。

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、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。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，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的计算结果对外予以公布。

### （四）估值程序

1、每百份基金已实现收益是按照相关法规计算的每百份基金份额的日已实现收益，精确到小数点后第4位，小数点后第5位四舍五入。本基金的收益分配是按日结转份额的，七

日年化收益率是以最近七日(含节假日)收益所折算的年资产收益率,精确到0.001%,百分号内小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值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。

#### (五) 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百份基金已实现收益小数点后4位或七日年化收益率百分号内小数点后3位以内发生差错时,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、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错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,则其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、估值错误处理的方法如下：

(1) 基金估值出现错误时，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。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场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。

(七) 基金净值的确认

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值与面值保持一致。该基金份额净值是计算基金申购与赎回价格的基础。

用于基金信息披露的基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率并发送给基金托管人。基金托管人复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对每百份基金已实现收益和七日年化收益率予以公布。

(八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按照估值方法的第 3 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由



此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十五 基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

基金收益指基金投资所得债券利息、票据投资受益、买卖证券价差、银行存款利息和其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

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。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金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，计入投资人收益账户，免收再投资的费用。投资人收益账户里的权益和其证券账户内的基金份额一起参与当日的收益分配，并享有同等收益分配权；
- 3、“每日分配、利随本清”。本基金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，记入投资人收益账户。投资人赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。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；
- 4、本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益，当日所得收益满足结转条件的结转为基金份额；若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益等于零时，则当日投资人不记收益；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，为投资人记负收益。基金管理人根据以上基金收益分配原则确定投资者的收益份额，并委托中国结算办理相应的基金份额收益结转的变更登记；
- 5、投资人卖出部分基金份额时，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；
- 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、投资人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、投资人收益账户内高于100元以上的整百元收益将结转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；
- 9、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定。

### （五）收益分配的时间和程序

本基金每个工作日进行收益分配。每个开放日公告前一个开放日每百份基金已实现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自然日，披露节假日期间的每百份基金已实现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的每百份基金已实现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。

本基金每日例行的收益分配不再另行公告。

（六）本基金每百份基金已实现收益及七日年化收益率的计算见基金合同第二十部分。

## 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、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、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、基金上市费及年费；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月起 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动划扣后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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 0.09% 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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月起 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动划扣后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 3. 基金销售服务费

本基金的年销售服务费率为 0.25%，销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理核对一致的财务数据，自动在次月起 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。费用自动划扣后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类中第 4—11 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或者摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （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。

### （五）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率或销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过，但法律法规要求提高该等报酬标准或费率的除外。

## 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；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时, 本基金从其最新规定。

### (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介和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“指定媒介”)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。

基金募集申请在中国证监会注册后，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（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）在指定媒介上登载基金合同生效公告。

## 4、基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率公告

(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、每百份基金已实现收益和七日年化收益率；

每百份基金已实现收益和七日年化收益率的计算方法如下：

### 1) 每百份基金已实现收益

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

其中，当日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。

### 2) 七日年化收益率

基金按日结转的七日年化收益率的计算公式为：

$$\text{按日结转的七日年化收益率 (\%)} = \left\{ \left[ \prod_{i=1}^7 \left( 1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{365/7} - 1 \right\} \times 100\%$$

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，七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。

(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，披露开放日的每百份基金已实现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自然日，披露节假日期间基金份额的每百份基金已实现收益、节假日最后一日基金份额的七日年化收益率，以及节假日后首个开放日基金份额的每百份基金已实现收益和七日年化收益率；

(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、每百份基金已实现收益和七日年化收益率。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、每百份基金已实现收益和七日年化收益率登载在指定媒介上。



#### 5、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒介上公告。

#### 6、基金份额上市交易公告

基金份额获准在证券交易所上市交易时,基金管理人应在基金份额上市交易 3 个工作日前,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 50%;
- (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 30%;

- (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) 基金管理费、基金托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金资产净值估值错误达基金资产净值 0.5%；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 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%的情形时；
- (27) 本基金推出新业务或服务；
- (28) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

在基金合同存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格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,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

## 11、中国证监会规定的其他信息。

### (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基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、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介披露信息，但是其他公共媒介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。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

#### （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信息的情形

- 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基金份额持有人的利益决定延迟估值时；
- 4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

## 十九 基金的风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险和其它风险。

### （一）投资组合的风险

投资组合风险主要包括系统性风险、非系统性风险以及流动性风险。

#### 1、系统性风险

证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动，从而导致基金收益水平变化，使本基金资产面临的风险。主要包括：

（1）政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险；

（2）经济周期风险：经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于债券，收益水平也会随之发生变化，从而产生风险；

（3）利率风险：金融市场利率的波动会导致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。基金投资于债券，收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险；

（4）购买力风险：基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

#### 2、非系统性风险

非系统性风险是指单个证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等，都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资债券的发行人经营不善，导致所投资的企业债券发行人无法按时偿付本息，从而使基金投资收益下降。

#### 3、流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金是契约型开放式基金，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

#### 4、影子价格和摊余成本法估值的偏离风险

由于本基金采用摊余成本法计算资产净值，当市场利率出现大的波动，基金的影子价格和摊余成本法的估值之间可能会发生比较大的偏离。当两者偏离度较大时，可能给基金份额持有人带来损失。

### 5、当日收益为负的风险

作为货币基金，在大多数情况下，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。这时显示的基金每百份收益可能为负。

#### （二）管理风险

基金的管理风险主要包括两个方面：一是在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。另一方面，基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

基金的管理风险包括以下几种具体风险：

##### 1、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误；或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门；或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益的直接损失。

##### 2、系统故障风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

##### 3、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手方的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

##### 4、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

##### 5、申购、赎回限制调整风险

基金管理人在保护现有基金持有人利益的前提下，可以根据实际情况设定申购、赎回的上限或暂停基金的申购、赎回业务。影响基金申购、赎回业务的因素包括但不限于基金规模、基金资产流动性、证券市场的流动性（如在季末、年末等特殊时点全市场资金流动性紧张等）以及本基金特有的风险，如新股发行、隔夜拆借利率走高和市场上涨行情等特定情况均有可能对本基金的流动性造成一定的影响。

#### （三）投资合规性风险

投资合规性风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而可能引起法律制裁、重大财务损失或者声誉损失的风险，主要合规风险包括如下具体风险：

##### 1、法律风险

法律风险是指基金管理人违反法律法规、基金合同从而给基金份额持有人利益带来损失的风险。

## 2、道德风险

道德风险是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

### （四）本基金的特有风险

本基金在上海证券交易所上市交易，对于选择买卖的投资人而言，交易费用和二级市场流动性等因素都会在一定程度上影响投资人的投资收益，由于货币基金的每日收益有限，交易费用会降低投资人的投资收益；另外，二级市场的价格受供需关系的影响，可能高于或低于基金的份额净值，形成溢价交易或折价交易。当溢价交易时，买入份额的投资人以高于面值的价格买入本基金，投资收益减少，而卖出份额的投资人以高于面值的价格卖出本基金，投资收益增加；当折价交易时，买入份额的投资人以低于面值的价格买入本基金，投资收益增加，而卖出份额的投资人以低于面值的价格卖出本基金，投资收益减少。

当日申请的本基金份额自下一工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额及其对应的收益自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益。投资人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。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。

由于上海证券交易所可根据基金管理人的要求对本基金当日的赎回申请进行总量控制，所以投资人可能面临无法及时赎回本基金的风险。

### （五）其他风险

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份额持有人利益受损。

## 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应当报中国证监会备案，且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，经履行适当程序后，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）对基金剩余财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### （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剩余财产中支付。

（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基金份额比例进行分配。

（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。



## 二十一 基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1、基金份额持有人的权利

- (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;
- (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、基金销售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、基金份额持有人的义务

- (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) 缴纳基金认购、申购、赎回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。

### 3、基金管理人的权利

- (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规定或中国证监会批准的其他费用;
- (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，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；
- (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。

#### 4、基金管理人的义务

- (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基金资产净值，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。

##### 5、基金托管人的权利

- (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, 如发现基金管理人有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。

## 6、基金托管人的义务

(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、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

1、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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构,如今后设立基金份额持有人大会的日常机构,日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

2、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,法律法规和中国证监会另有规定的除外;

(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,法律法规和中国证监会另有规定的除外;

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准或费率的除外;

(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,但法律法规和中国证监会另有规定的除外;

(9) 变更基金份额持有人大会程序,但法律法规和中国证监会另有规定的除外;

(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) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(13) 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。

3、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以及对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下,调整基金的销售服务费率或变更收费方式;

(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) 在法律法规和本基金合同规定的范围内以及对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下, 基金推出新业务或服务;

(7) 在法律法规和本基金合同规定的范围内以及对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下, 经中国证监会允许, 基金管理人、代销机构、注册登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回等业务的规则;

(8) 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。

#### 4、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) 基金份额持有人大会未设立日常机构的, 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) 基金份额持有人大会未设立日常机构的, 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。

#### 5、通知

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。

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。

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。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式及法律法规、中国证监会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%）。

3) 若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的，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，到会者所持有的有效基金份额应不少于在重新确定的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 50%（含 50%）；

4) 若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的，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，到会者所持有的有效基金份额应不少于在重新确定的权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）；

5) 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；

6) 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、电话或其他监管机构允许的方式进行表决，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、电话或其他监管机构允许的方式，具体方式在会议通知中列明。

## 7、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 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。

## 8、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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。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。

## 9、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。

## 10、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，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。

11、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，基金管理人经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) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1、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在中国证监会备案后方可执行，自决议生效之日起在指定媒介公告。

## 2、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行适当程序后，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。

## 3、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) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

## 4、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剩余财产中支付。

## 5、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基金份额比例进行分配。

#### 6、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。

#### 7、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。

#### （四）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，如经一方提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费和律师费由败诉方承担。

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管辖。

#### （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

#### 1、基金管理人

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司  
注册地址：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  
办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  
邮政编码：200135  
法定代表人：齐亮  
成立时间：2004 年 11 月 18 日  
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号  
组织形式：有限责任公司  
注册资本：贰亿元人民币  
存续期间：持续经营  
经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)  
住所：北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  
邮政编码：100033  
法定代表人：王洪章  
成立时间：2004 年 09 月 17 日  
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字【1998】12 号  
组织形式：股份有限公司  
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整  
存续期间：持续经营  
经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### (二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同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池，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。本基金投资于以下金融工具：现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单等银行存款、期限在1年以内（含1年）的债券回购、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、中期票据、资产支持证券等债券品种，以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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，对基金投资、融资比例进行监督。

（1）基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

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）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过该证券的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%，据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，可不受此限制；

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%。本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；

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）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

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%；

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）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

12）中国证监会、中国人民银行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 个交易日内进行调整，以达到上述标准。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，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本基金合同生效之日起开始。

(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。

(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。

(4) 如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，经履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

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，对托管协议第十五条第十二款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

4、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。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行

业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、每百份基金已实现收益、七日年化收益率、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。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

8、基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，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、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、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，由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对



方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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）基金财产的保管

#### 1、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）基金托管人应安全保管基金财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的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，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人按照基金合同和托管协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产，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账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人应予以必要的协助，但对此不承担任何责任。
- （7）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### 2、基金募集期间及募集资金的验资

- （1）基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- （2）基金募集期满或基金停止募集时，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，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

（3）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等事宜。

#### 3、基金银行账户的开立和管理

（1）基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

（2）基金银行账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### 4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用,仅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或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 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开立结算备付金账户,并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、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,若无相关规定,则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定,在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户,持有人账户和资金结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(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。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除托管协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

#### （四）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值的计算、每百份基金已实现收益和七日年化收益率的计算、复核与完成的时间及程序

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。每百份基金已实现收益是按照相关法规计算的每百份基金份额的日已实现收益，精确到小数点后第 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。本基金的收益分配是按日结转份额的，七日年化收益率是以最近七日（含节假日）收益所折算的年资产收益率，精确到 0.001%，百分号内小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个交易日计算基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率，经基金托管人复核，按规定公告。

（2）基金管理人应每个交易日对基金资产估值。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。基金管理人每个交易日对基金资产估值后，将每百份基金已实现收益和七日年化收益率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。

#### 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

##### （1）估值对象

基金所拥有的各类证券和银行存款本息、备付金、保证金及其他资产和所承担的金融负债。

##### （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。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。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

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,同时基金管理人应编制并披露临时报告。

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) 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。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,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,仍无法达成一致意见的,基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (3) 特殊情形的处理

1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(3)项进行估值时,所造成的误差不作为估值错误处理;

2) 由于不可抗力,或证券交易所、登记机构及存款银行发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

### 3、估值错误的处理方式

(1) 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百份基金已实现收益小数点后4位或七日年化收益率百分号内小数点后3位以内发生差错时,视为估值错误。;出现估值错误时,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;当发生净值计算错误时,由基金管理人负责处理,由此给基金份额持有人和基金造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金

管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金估值错误给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

2) 若基金管理人计算的基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

3) 如基金管理人和基金托管人对基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金资产净值、每百份基金已实现收益和七日年化收益率计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 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。

(4) 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。

#### 4、暂停估值与公告基金资产净值、每百份基金已实现收益、七日年化收益率的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易市场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；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(4) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。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。

#### 7、基金财务报表与报告的编制和复核

##### (1) 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### (2) 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### (3) 财务报表的编制与复核时间安排

###### 1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，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。

###### 2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

8、基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### (五) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应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注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

#### (六) 适用法律和争议解决方式

各方当事人同意，因托管协议产生或与之相关的争议，如经一方提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均有约束力，仲裁费和律师费由败诉方承担。

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

托管协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、托管协议的变更程序

托管协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

- （1）基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。

##### 3、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) 将清算结果报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

(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,清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

(7) 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基金份额比例进行分配。

(8) 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。

(9) 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。



### 二十三 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构及各代销机构提供。

基金管理人提供的主要服务内容如下：

#### 1、 电话呼叫中心

呼叫中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值信息等。同时，呼叫中心提供工作日 9：00—17：30 的人工服务。

电话呼叫中心电话：400—888—0001（免长途费），或 021-38784638，按“0”可转人工坐席传真：021-50103016

#### 2、 网上客户服务中心

网上客户服务为投资人提供查询服务、资讯服务以及相互交流的平台。登录网站后，投资人可以查询基金相关信息；并可根据不同的客户分类，享受不同的资讯服务；投资人还可以查询热点问题及其解答，并提交投诉和建议。

公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

#### 3、 客户投诉处理

投资人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、客户服务中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

## 二十四 其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2015 年 7 月 14 日至 2016 年 1 月 13 日），下列公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报和基金管理人公司网站：

公告内容	披露时间
华泰柏瑞交易型货币基金 2016 年元旦节前暂停申购业务的公告	2015-12-28
华泰柏瑞交易型货币基金和沪深 300ETF 增加一级交易商的公告	2015-12-16
关于华泰柏瑞交易型货币市场基金证券交易佣金设置为零的证券公司名单的提示性公告	2015-12-10
华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	2015-12-02
华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	2015-11-11
华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	2015-10-27
华泰柏瑞货币 etf2015 年第三季度报告	2015-10-27
华泰柏瑞交易型货币基金 2015 年国庆节前暂停申购业务的公告	2015-09-28
关于华泰柏瑞交易型货币市场基金证券交易佣金设置为零的证券公司名单的提示性公告	2015-09-17
华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	2015-09-09
关于华泰柏瑞交易型货币市场基金证券交易佣金设置为零的证券公司名单的提示性公告	2015-07-31
华泰柏瑞交易型货币市场基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告	2015-07-29
华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同生效公告	2015-07-15

## 二十五 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十六 备查文件

- (一) 在中国证监会注册华泰柏瑞交易型货币市场基金募集的文件；
- (二) 《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》；
- (三) 《华泰柏瑞交易型货币市场基金托管协议》；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司  
二〇一六年二月二十三日