

## 华泰柏瑞交易型货币市场基金更新的招募说明书(摘要)2016年第2号

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。

### 重要提示

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7月13日，有关财务和业绩表现数据截止日为2016年6月30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。

### 一、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 年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。2016年5月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益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，11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) 违反证券交易场所业务规则，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营成本，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。

## 二、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。本行于 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 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，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、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 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 220 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，资产托管业务部总经理，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，资产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等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产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，资产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 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 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 年至今连续六年被国际权威杂志《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。资产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

资产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等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，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，对指令要素等内容进行核查。
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和投资独立性等方面进行评价，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。

### 三、相关服务机构

#### （一）一级代办券商

##### 1) 安信证券股份有限公司 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 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 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 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 法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹 联系人：陈剑虹

电话：（0755）82825551 电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355 传真：（0755）82558355

客服电话：400-800-1001 客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn 公司网址：www.essence.com.cn

##### 2) 渤海证券股份有限公司 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 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 办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰 法定代表人：王春峰

联系人：王星 联系人：王星

电话：（022）28451922 电话：（022）28451922

传真：（022）28451892 传真：（022）28451892

客服电话：400-651-5988 客服电话：400-651-5988



公司网址: www.bhzq.com 公司网址: www.bhzq.com

3) 财达证券有限责任公司 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 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 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 法定代表人: 翟建强

联系人: 胡士光 联系人: 胡士光

电话: (0311) 66006403 电话: (0311) 66006403

传真: (0311) 66006249 传真: (0311) 66006249

客服电话: 400-612-8888 客服电话: 400-612-8888

公司网址: www.s10000.com 公司网址: www.s10000.com

4) 长城证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人: 黄耀华

联系人: 高峰 联系人: 高峰

电话: (0755) 83516094 电话: (0755) 83516094

传真: (0755) 83515567 传真: (0755) 83515567

客服电话: (0755) 33680000、400-6666-888 客服电话: (0755) 33680000、400-6666-888

公司网址: www.cgws.com 公司网址: www.cgws.com

5) 长江证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人: 胡运钊

联系人: 奚博宇 联系人: 奚博宇

电话: (021) 68751860 电话: (021) 68751860

传真: (021) 68751151 传真: (021) 68751151

客服电话: 95579 或 4008-888-999 客服电话: 95579 或 4008-888-999

公司客服网址: www.95579.com 公司客服网址: www.95579.com

6) 德邦证券股份有限公司 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 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 办公地址: 上海市福山路 500 号 26 楼

法定代表人: 姚文平 法定代表人: 姚文平

联系人: 朱磊 联系人: 朱磊

电话: (021) 68761616 电话: (021) 68761616

传真: (021) 68767981 传真: (021) 68767981

客服电话: 400-888-8128 客服电话: 400-888-8128

公司网址: www.tebon.com.cn 公司网址: www.tebon.com.cn

7) 第一创业证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：刘学民

联系人：吴军 联系人：吴军

电话：（0755）23838751 电话：（0755）23838751

传真：（0755）23838750 传真：（0755）23838750

客服电话：400-888-1888 客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn 公司网址：www.firstcapital.com.cn

8) 东北证券股份有限公司 8) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号 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 办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中 法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩 联系人：安岩岩

电话：（0431）85096517 电话：（0431）85096517

传真：（0431）85096795 传真：（0431）85096795

客服电话：4006000686，（0431）85096733 客服电话：4006000686，（0431）85096733

公司网址：www.nesc.cn 公司网址：www.nesc.cn

9) 东海证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦 联系人：王一彦

电话：021-20333333 电话：021-20333333

传真：021-50498825 传真：021-50498825

客服电话：95531 或 400-8888-588 客服电话：95531 或 400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn 公司网址：www.longone.com.cn

10) 东吴证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹 联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136 电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021 传真：（0512）65588021

客服电话：400-860-1555 或 96288 客服电话：400-860-1555 或 96288

公司网址：www.dwzq.com.cn 公司网址：www.dwzq.com.cn

11) 东兴证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川 联系人：汤漫川

电话：（010）66555316 电话：（010）66555316

传真：（010）66555246 传真：（010）66555246

客服电话：400-888-8993 客服电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net 公司网址：www.dxzq.net

12) 方正证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞 联系人：郭军瑞

电话：（0731）85832503 电话：（0731）85832503

传真：（0731）85832214 传真：（0731）85832214

客服电话：95571 客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com 公司网址：www.foundersc.com

13) 光大证券股份有限公司 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 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 办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰 法定代表人：薛峰

联系人：周洁瑾 联系人：周洁瑾

电话：（021）22169999 电话：（021）22169999

传真：（021）22169134 传真：（021）22169134

客服电话：95525 客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com 公司网址：www.ebscn.com

14) 广发证券股份有限公司 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） 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 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 法定代表人：孙树明

联系人：黄岚 联系人：黄岚

电话：（020）87555888 电话：（020）87555888

传真：（020）87555305 传真：（020）87555305

客服电话：95575 客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn 公司网址：www.gf.com.cn

15) 国都证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：常喆

联系人：黄静 联系人：黄静

电话：(010) 84183333 电话：(010) 84183333

传真：(010) 84183311-3389 传真：(010) 84183311-3389

客服电话：400-818-8118 客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com 公司网址：www.guodu.com

16) 国金证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏 联系人：刘婧漪

电话：028-86690057、028-86690058 电话：(028) 86690057

传真：028-86690126 传真：(028) 86690126

客服电话：95310 客服电话：4006-600109

公司网址：www.gjq.com.cn 公司网址：www.gjq.com.cn

17) 国泰君安证券股份有限公司 17) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 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 楼 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：杨德红 法定代表人：万建华

联系人：芮敏棋 联系人：芮敏棋

电话：(021) 38676666 电话：(021) 38676666

传真：(021) 38670666 传真：(021) 38670666

客服电话：95521 客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com 公司网址：www.gtja.com

18) 国信证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：何如

联系人：周杨 联系人：周杨

电话：(0755) 82130833 电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952 传真：(0755) 82133952

客服电话：95536 客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn 公司网址：www.guosen.com.cn

19) 恒泰证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：庞介民

联系人：扬子莹 联系人：扬子莹

电话：(0471) 4974437 电话：(0471) 4974437

客服电话：(0471) 4961259 客服电话：(0471) 4961259

公司网址：www.cnht.com.cn 公司网址：www.cnht.com.cn

20)申万宏源西部证券有限公司 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 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 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 法定代表人:李季

联系人:王君 联系人:王君

电话:0991-7885083 电话:0991-7885083

传真:0991-2301802 传真:0991-2301802

客服电话:400-800-0562 客服电话:400-800-0562

公司网址:www.swhysc.com 公司网址:www.swhysc.com

21)华宝证券有限责任公司 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 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 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 法定代表人:陈林

联系人:刘闻川 联系人:刘闻川

电话:68778790 电话:68778790

传真:68777992 传真:68777992

客服电话:4008209898 客服电话:4008209898

公司网址:www.cnhbstock.com 公司网址:www.cnhbstock.com

22)华福证券有限责任公司 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 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 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 法定代表人:黄金琳

联系人:徐松梅 联系人:徐松梅

电话:(0591)83893286 电话:(0591)83893286

传真:(0591)87383610 传真:(0591)87383610

客服电话:96326(福建省外请加拨0591) 客服电话:96326(福建省外请加拨0591)

公司网址:www.hfzq.com.cn 公司网址:www.hfzq.com.cn

23)华泰证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人:吴万善

联系人:庞晓云 联系人:庞晓云

电话:(0755)82569143 电话:(0755)82569143

传真:(0755)82492962 传真:(0755)82492962

客服电话:95597 客服电话:95597

公司网址:www.htsc.com.cn 公司网址:www.htsc.com.cn

24)华鑫证券有限责任公司 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 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 办公地址：上海市肇家浜路 750 号

法定代表人：俞洋 法定代表人：俞洋

联系人：陈敏 联系人：陈敏

电话：(021) 64316642 电话：(021) 64316642

传真：(021) 64333051 传真：(021) 64333051

客服电话：400-109-9918、021-32109999、029-68918888 客服电话：400-109-9918、021-32109999、  
029-68918888

公司网址：www.cfsc.com.cn 公司网址：www.cfsc.com.cn

25)平安证券有限责任公司 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 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 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 法定代表人：杨宇翔

联系人：吴琼 联系人：吴琼

电话：(0755) 22621866 电话：(0755) 22621866

传真：(0755) 82400862 传真：(0755) 82400862

客服电话：95511\*8 客服电话：95511\*8

公司网址：stock.pingan.com 公司网址：stock.pingan.com

26)上海证券有限责任公司 26) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号 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 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 法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华 联系人：许曼华

电话：021-53686888 电话：021-53686888

传真：021-53686100, 021-53686200 传真：021-53686100, 021-53686200

客服电话：021-962518 客服电话：021-962518

公司网址：www.962518.com 公司网址：www.962518.com

27)申万宏源证券有限公司 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 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 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅 法定代表人：李梅

联系人：黄莹 联系人：黄莹

电话：(021) 33389888 电话：(021) 33389888

传真：(021) 33388224 传真：(021) 33388224

客服电话：95523 或 4008895523 客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com 公司网址：www.swhysc.com

28)万联证券有限责任公司 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 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 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 法定代表人：张建军

联系人：甘蕾 联系人：甘蕾

电话：（020）38286026 电话：（020）38286026

传真：（020）37865008 传真：（020）37865008

客服电话：400-888-8133 客服电话：400-888-8133

公司网址：www.wlzq.com.cn 公司网址：www.wlzq.com.cn

29)西南证券股份有限公司 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 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 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 法定代表人：余维佳

联系人：张煜 联系人：张煜

电话：（023）63786141 电话：（023）63786141

传真：（023）63810422 传真：（023）63810422

客服电话：400-809-6096 客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn 公司网址：www.swsc.com.cn

30)湘财证券有限责任公司 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 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 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 法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺 联系人：钟康莺

电话：（021）68634518 电话：（021）68634518

传真：（021）68865680 传真：（021）68865680

客服电话：400-888-1551 客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com 公司网址：www.xcsc.com

31)新时代证券股份有限公司 31)信达证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 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：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 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：刘汝军 法定代表人：张志刚

联系人：卢珊 联系人：尹旭航

电话：（010）83561072 电话：010-63081000

传真：（010）83561094 传真：010-63080978

客服电话：400-698-9898 客服电话：95321

公司网址：www.xsdzq.cn 公司网址：www.cindasc.com

32)信达证券股份有限公司 32)兴业证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 注册地址：福建省福州市湖东路268号

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 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：张志刚 法定代表人：兰荣

联系人：尹旭航 联系人：夏中苏

电话：010-63081000 电话：（0591）38281963

传真：010-63080978 客服电话：400-888-8123

客服电话：95321 公司网址：www.xyzq.com.cn

公司网址：www.cindasc.com 33) 浙商证券股份有限公司

33) 兴业证券股份有限公司 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

注册地址：福建省福州市湖东路268号 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

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：吴承根

法定代表人：兰荣 联系人：张梦莹

联系人：夏中苏 电话：（021）64718888

电话：（0591）38281963 传真：（0571）87901913

客服电话：400-888-8123 客服电话：（0571）95345

公司网址：www.xyzq.com.cn 公司网址：www.stocke.com.cn

34) 浙商证券股份有限公司 34) 中国国际金融股份有限公司

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 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：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：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层

法定代表人：吴承根 法定代表人：丁学东

联系人：张梦莹 联系人：罗文雯

电话：（021）64718888 电话：（021）58763575

传真：（0571）87901913 传真：（021）68875123

客服电话：（0571）95345 客服电话：（021）58796226-3736

公司网址：www.stocke.com.cn 公司网址：www.cicc.com.cn

35) 中国国际金融股份有限公司 35) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层 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：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层 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：丁学东 法定代表人：高涛

联系人：罗文雯 联系人：刘毅

电话：（021）58763575 电话：（0755）82023442

传真：（021）68875123 传真：（0755）82026539

客服电话：（021）58796226-3736 客服电话：95532

公司网址：www.cicc.com.cn 公司网址：www.china-invs.cn

36) 中国中投证券有限责任公司 36) 中信建投证券股份有限公司

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 注册地址：北京市安立路66号4号楼

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 办公地址：北京市朝阳区内大街188号

法定代表人：高涛 法定代表人：王常青

联系人：刘毅 联系人：权唐

电话：（0755）82023442 电话：400-8888-108

传真：（0755）82026539 传真：（010）65182261



客服电话：95532 客服电话：400-888-8108

公司网址：www.china-invs.cn 公司网址：www.csc108.com

37) 中信建投证券股份有限公司 37) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：北京市安立路66号4号楼 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：北京市朝阳区门内大街188号 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：王常青 法定代表人：杨宝林

联系人：权唐 联系人：赵艳青

电话：400-8888-108 电话：(0532) 85022326

传真：(010) 65182261 传真：(0532) 85022605

客服电话：400-888-8108 客服电话：95548

公司网址：www.csc108.com 公司网址：www.citicssd.com

38) 中信证券(山东)有限责任公司 38) 中信证券股份有限公司

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 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：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) 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：杨宝林 法定代表人：王东明

联系人：赵艳青 联系人：侯艳红

电话：(0532) 85022326 电话：(010) 60838888

传真：(0532) 85022605 传真：(010) 60833739

客服电话：95548 客服电话：95558

公司网址：www.citicssd.com 公司网址：www.cs.ecitic.com

39) 中信证券股份有限公司 39) 中原证券股份有限公司

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 注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：王东明 法定代表人：菅明军

联系人：侯艳红 联系人：程月艳、范春艳

电话：(010) 60838888 电话：(0371) 69099882

传真：(010) 60833739 传真：(0371) 65585899

客服电话：95558 客服电话：95377

公司网址：www.cs.ecitic.com 公司网址：www.ccnew.com

40) 中原证券股份有限公司 40) 华安证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号 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：郑州市郑东新区商务外环路10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：菅明军 法定代表人：李工

联系人：程月艳、范春艳 联系人：范超

电话：(0371) 69099882 电话：0551-65161821

传真：(0371) 65585899 传真：0551-65161672

客服电话：95377 客服电话：400-809-6518(全国) 96518(安徽)

公司网址: www.ccnew.com 公司网址: www.hazq.com

41) 华安证券股份有限公司 41) 江海证券有限公司

注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 注册地址: 哈尔滨香坊区赣水路 56 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 办公地址: 哈尔滨香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 李工 法定代表人: 孙名扬

联系人: 范超 联系人: 周俊

电话: 0551-65161821 电话: 0451-85863726

传真: 0551-65161672 传真: 0451-82337279

客服电话: 400-809-6518 (全国) 96518 (安徽) 客服电话: 400-666-2288

公司网址: www.hazq.com 公司网址: www.jhzq.com.cn

42) 江海证券有限公司 42) 太平洋证券股份有限公司

注册地址: 哈尔滨香坊区赣水路 56 号 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: 哈尔滨香坊区赣水路 56 号 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: 孙名扬 法定代表人: 李长伟

联系人: 周俊 联系人: 唐昌田

电话: 0451-85863726 电话: 010-88321717

传真: 0451-82337279 传真: 010-88321763

客服电话: 400-666-2288 客服电话: 400-665-0999

公司网址: www.jhzq.com.cn 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

#### 四、基金的名称

华泰柏瑞交易型货币市场基金

## 五、基金的类型

货币市场基金

## 六、基金的投资目标

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。

## 七、基金的投资范围

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。

## 八、基金的投资策略

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。

## 九、基金的业绩比较基准

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。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金的投资组合报告

投资组合报告截止日为2016年6月30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 758,740,088.81 47.98

其中：债券 758,740,088.81 47.98

资产支持证券 -

-

2 买入返售金融资产 154,050,632.83

9.74

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 661,076,805.16 41.81

4 其他资产 7,433,459.33 0.47

5 合计 1,581,300,986.13 100.00

## 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 11.19

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 231,263,444.36 17.14

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 88

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 107

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 57

### (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 34.47 17.14

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

2 30 天(含)-60 天 13.32 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

3 60 天(含)-90 天 29.61 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

4 90 天(含)-180 天 24.49 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

5 180 天(含)-397 天(含) 14.79 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 - -

合计 116.68 17.14

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 --

2 央行票据 --

3 金融债券 90,002,411.01 6.67

其中：政策性金融债 90,002,411.01 6.67

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 300,376,407.07 22.27

6 中期票据 --

7 其他 368,361,270.73 27.31

8 合计 758,740,088.81 56.25

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 041557005 15 中色 CP002 1,000,000 100,193,482.42 7.43

2 041558105 15 蒙中电 CP001 500,000 50,176,460.32 3.72

3 111610240 16 兴业 CD240 500,000 50,000,000.00 3.71

4 011699508 16 紫金矿业 SCP003 500,000 49,985,802.43 3.71

5 111610041 16 兴业 CD041 500,000 49,922,492.18 3.70

6 111690282 16 杭州银行 CD013 500,000 49,901,449.09 3.70

7 111610236 16 兴业 CD236 500,000 49,837,968.62 3.69

8 111611182 16 平安 CD182 500,000 49,801,764.32 3.69

9 111611225 16 平安 CD225 500,000 49,693,876.92 3.68

10 111617126 16 光大 CD126 500,000 49,660,941.05 3.68

#### 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 0.0910%

报告期内偏离度的最低值 -0.0177%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0275%

#### 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	6,321.88
3	应收利息	7,427,137.45
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,433,459.33

## 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 2016 年 6 月 30 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

华泰柏瑞货币 ETFA 级

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(2016年4月1日—2016年6月30日) 0.5806% 0.0030% 0.0885% 0.0000% 0.4921% 0.0030%

基金合同生效日(2015年7月14日)至2015年12月31日 1.2414% 0.0041% 0.1663% 0.0000% 1.0751%

0.0041%

基金合同生效日(2015年7月14日)至2016年6月30日 2.5141% 0.0036% 0.3432% 0.0000% 2.1709%

0.0036%

华泰柏瑞货币 ETFB 级

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③  
②-④

过去三个月(2016年4月1日—2016年6月30日) 0.5490% 0.0034% 0.0885% 0.0000% 0.4605% 0.0034%

份额增设日(2016年2月26日)至2016年6月30日 0.7437% 0.0034% 0.1225% 0.0000% 0.6212% 0.0034%

注：本基金于 2 月 26 日新增 B 类份额。

### 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

注：本基金于2016年2月26日新增B类份额，上述A级指标计算日期为2015年7月14日至2016年6月30日，上述B级指标计算日期为2016年2月26日至2016年6月30日。

### 十三、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。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、“三、基金管理人”部分，对总经理及其他高级管理人员、本基金基金经理、投资决策委员会成员作了更新。
- 2、“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
- 3、“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的相关信息；
- 4、“十一、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
- 5、“十二、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
- 6、“二十四、其他应披露事项”部分，根据前次招募说明书（更新）公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日