

# 华泰柏瑞交易型货币市场基金

## 更新的招募说明书摘要

### 2019年第3号（基金合同和托管协议变更）

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者而言，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者的投资收益，由于货币基金的每日收益有限，交易费用会降低投资者的投资收益；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，买入份额的投资者以高于面值的价格买入本基金，投资收益减少，而卖出份额的投资者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，买入份额的投资者以低于面值的价格买入本基金，投资收益增加，而卖出份额的投资者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，所以投资者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（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要。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。

本更新招募说明书根据2019年12月30日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下61只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告》，依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》对基金信息披露相关内容进行修订，对基金合同和托管协议变更事项进行更新。

本更新招募说明书关于基金合同和托管协议变更事项及基金管理人、基金托管人信息的内容截止日为2019年12月30日，除非另有说明，本更新招募说明书所载其余内容截止日为2019年7月13日，有关财务和业绩表现数据截止日为2019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。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

## 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：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

法定代表人：贾波

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

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001年7月至2016年11月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理（主持工作）、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016年12月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

陆春光先生：董事，学士，2009年5月加入华泰证券，曾任网络金融部互联网运营团队负责人、用户体验与设计团队负责人、副总经理，现任华泰证券上海分公司副总经理（主持工作）。

Anthony Fasso 先生：董事，学士，1984年加入 Bankers Trust，1995年至2000年先后任 Bankers Trust Funds Management 董事（亚洲）、高级副总裁及常务董事（香港）。2000年至2001年担任 iRegent Group Limited 营销经理（香港），2001年至2003年担任 Julius Baer Investment Advisory (Asia) Ltd 行政总裁及机构资产管理部门主管（香港），2003年至2004年担任 Deutsche Asset Management 私人财富管理董事（墨尔本），2005年至2010年担任 AXA Investment Managers 亚太区行政总裁及全球执行委员会成员（巴黎/香港），2010年至2018年担任 AMP Capital 国际业务行政总裁及全球客户部门（香港）主管，2019年至今担任柏瑞投资行政总裁（亚洲，日本除外）。

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。

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。

李晗女士：独立董事，硕士，2007年加入天元律师事务所，2015年至今任该律师事务所合伙人。

李亦宜女士：独立董事，硕士，曾任职于 Lazard & Co. 旧金山办事处以及 Lazard Asia 香港办事处，2010年至2013年曾担任 Japan Residential Assets Management Limited 董

事。2002 年至今历任 Argyle Street Management Limited 基金经理、执行董事，2006 年至今同时担任新加坡上市公司 TIH Limited 董事。

文光伟先生：独立董事，博士，1983 年至 2015 年先后任中国人民大学会计系助教、会计系讲师、中国人民大学商学院会计系副教授、硕士生导师，1989 年 12 月至 1991 年 6 月期间兼职于香港普华会计公司审计部。2015 年 3 月从中国人民大学退休。

陆楨女士：独立董事，硕士，曾任中国金融租赁有限公司副总经理、北京启迪清云智慧能源有限公司高级副总裁，2018 年至今任融讯商业保理（深圳）有限公司创始人兼 CEO，2019 年至今任北京清谊厚泽投资有限公司副总裁。

## 2、监事会成员

王永筠女士：监事长，硕士，香港会计师公会会员。2004 年至 2008 年任职于德勤，2008 年至 2019 年担任黑石集团（香港）有限公司财务部门董事，2019 年起担任柏瑞投资财务部门高级副总裁（亚洲，日本及台湾除外）。

刘晓冰先生：监事，二十四年证券从业经历。1993 年 12 月进入公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

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。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。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 月起兼任华泰柏瑞沪深 300ETF 基金、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 500 ETF 及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月起任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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。2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型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。

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专业，EMBA毕业于上海交通大学中欧国际工商学院。

李晓西先生：副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易

结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018年8月起任公司副总经理。

刘万方先生：财政部财政科学研究所财政学博士。曾任中国普天信息产业集团公司项目投资经理，美国MBP咨询公司咨询顾问，中国证监会主任科员、副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长，朱雀股权投资管理股份有限公司副总经理，朱雀基金管理有限公司总经理。2019年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任公司副总经理。

#### 4、本基金基金经理

郑青女士，14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月至2017年11月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。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。2016年9月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。

朱向临女士，北京大学计算数学硕士。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、基金经理助理。2016年7月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金和华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2019年2月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。

#### 5、固定收益投资决策委员会成员

主席：副总经理董元星先生；

成员：固定收益部总监陈东先生；固定收益部副总监郑青女士；基金经理罗远航先生；基金经理朱向临女士。

列席人员：法律、风控相关人员。

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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，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他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守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

漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(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，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金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

#### 1、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：田国立

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)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、

托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 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。

## 2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珏，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3、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、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务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 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、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。

## 2、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。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

## 3、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

#### 1、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“新一代托管应用监督子系统”，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。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。

#### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，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，如有重大异常事项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）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，如有必要将及时报告中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、场内一级代办券商

A类基金份额：

##### 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：王连志

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：天津市南开区宾水西道 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.ewww.com.cn

##### 3) 财达证券股份有限公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

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) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

电话：(0731) 84403319

传真：(0731) 84403439

客服电话：400-88-35316

公司网址：www.cfzq.com

## 5) 财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：夏吉慧

电话：(0571) 87925129

传真：(0571) 87818329

客服电话：96336（浙江），400-869-6336（全国）

公司网址：www.ctsec.com

## 6) 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

## 7) 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：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：(021) 61118795

传真：(021) 68751151

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

8) 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

9) 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

10) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

11) 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：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

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

12) 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](http://www.dwzq.com.cn)

13) 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](http://www.dxzq.net)

14) 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](http://www.foundersc.com)

15) 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

16) 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：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

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

17) 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

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

18) 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、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客服电话：95310

公司网址：www.gjqz.com.cn

19) 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

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

法定代表人：杨德红

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

20) 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

21) 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：4001966188

公司网址：www.cnht.com.cn

22) 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 35 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

电话：0991-2307105

传真：0991-2301802

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.swhysc.com

## 23) 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

## 24) 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

## 25) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓云

电话：025-883389093

传真：0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

## 26) 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](http://www.cfsc.com.cn)

27) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：石静武

电话：（021）38631117

传真：（021）58991896

客服电话：95511\*8

公司网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

28) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

客服电话：95538

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

29) 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)

30) 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

31) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：中国武汉武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系人：崔成

电话：027-87610052

传真：027-87618863

客服电话：400-800-5000

公司网址：www.tfzq.com

32) 万联证券股份有限公司

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

33) 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：吴坚

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

34) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

35) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：叶顺德

联系人：田芳芳

电话：010-83561146

传真：(010) 83561094

客服电话：95399

公司网址：www.xsdzq.cn

36) 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

37) 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

38) 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](http://www.stocke.com.cn)

39) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：(010) 6505 1166 - 6493

传真：(010) 8567 9535

客服电话：410-910-1166

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

40) 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](http://www.china-invs.cn)

41) 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

42) 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：sd.citics.com

43) 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：张佑君

联系人：郑慧

电话：010-60838888

传真：010-60836029

客服电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

44) 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

45) 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](http://www.hazq.com)

46) 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](http://www.jhzq.com.cn)

47) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

电话：0351-4130322

传真：0351-7219891

客服电话：400-712-1212

公司网址：<http://www.dtsbc.com.cn>

## 2、场外销售机构

本基金管理人直销柜台及如下代销机构接受投资者对本基金 B 类基金份额的申购和赎回。

1) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号二号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 26 楼

法定代表人：其实

联系人：王超

传真：021-54509953

客服电话：400-181-8188

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

## 2) 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：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

## 3) 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：张佑君

联系人：郑慧

电话：010-60838888

传真：010-60836029

客服电话：95548

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

## 4) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：王超

电话：010-59053660

传真：010-59053700

服务电话：95510

公司网址：<http://fund.sinosig.com/>

## 5) 嘉实财富管理有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：余永键

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客服电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

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，并及时在基金管理人网站公示。

## （二）注册登记机构

A类基金份额：

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

B类基金份额：

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

法定代表人：贾波

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层

电话：400-888-0001，（021）38601777

传真：（021）50103016

联系人：赵景云

除非基金管理人另行公告，A类基金份额与B类基金份额之间不能进行转换，且B类基金份额不能上市交易。

## （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：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：单峰、曹阳

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；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

## 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 2019 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	374,357,208.67	40.66
	其中：债券	364,357,208.67	39.58
	资产支持证券	10,000,000.00	1.09
2	买入返售金融资产	309,292,647.02	33.60
	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	231,884,694.85	25.19
4	其他资产	5,095,025.71	0.55
5	合计	920,629,576.25	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	6.63	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00

**债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明**

注：本报告期内本基金债券正回购的资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	35
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

2) 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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 120 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	63.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	7.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.17	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	7.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.54	-

4) 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	19,974,311.51	2.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,014,362.87	5.44
	其中：政策性金融债	50,014,362.87	5.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,910,473.40	16.30
6	中期票据	-	-
7	同业存单	144,458,060.89	15.71
8	其他	-	-
9	合计	364,357,208.67	39.61
10	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	180209	18国开09	500,000	50,014,362.87	5.44
2	111913034	19浙商银行CD034	500,000	49,697,923.00	5.40

3	011901232	19 大唐新能 SCP001	400,000	39,986,767.99	4.35
4	011802141	18 鲁钢铁 SCP018	300,000	30,001,941.01	3.26
5	111815333	18 民生银行 CD333	300,000	29,975,772.45	3.26
6	011900648	19 澜沧江 SCP005	300,000	29,965,447.78	3.26
7	011900521	19 山东电力 SCP001	300,000	29,956,103.58	3.26
8	111810508	18 兴业银行 CD508	300,000	29,935,604.31	3.25
9	111918161	19 华夏银行 CD161	300,000	29,861,609.87	3.25
10	011900217	19 重汽 SCP001	200,000	20,000,213.04	2.17

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0778%
报告期内偏离度的最低值	-0.0116%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0325%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

注：本基金本报告期内负偏离度绝对值未达到 0.25%。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

注：本基金本报告期内正偏离度绝对值未达到 0.5%。

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	159180	信泽 02A1	100,000	10,000,000.00	1.09

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) 本基金本报告期末投资的前十名证券中，中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 11 月 9 日对 18 民生银行 CD333 的发行主体中国民生银行股份有限公司作出行政处罚决定，对公司贷款业务严重违法审慎经营规则罚款 200 万元，对相关责任人处以警告并罚款。以及对公司内控管理严重违法审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等行为处以罚款 3160 万元。对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2.69
2	应收证券清算款	24,336.16
3	应收利息	5,070,686.86
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,095,025.71

## 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 2019 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 ETF 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 6 个	1.2174%	0.0021%	0.1760%	0.0000%	1.0414%	0.0021%

月						
2018年	3.4713%	0.0030%	0.3549%	0.0000%	3.1164%	0.0030%
2017年	3.8592%	0.0025%	0.3549%	0.0000%	3.5043%	0.0025%
2016年	2.5931%	0.0031%	0.3558%	0.0000%	2.2373%	0.0031%
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%

华泰柏瑞货币 ETFB 级

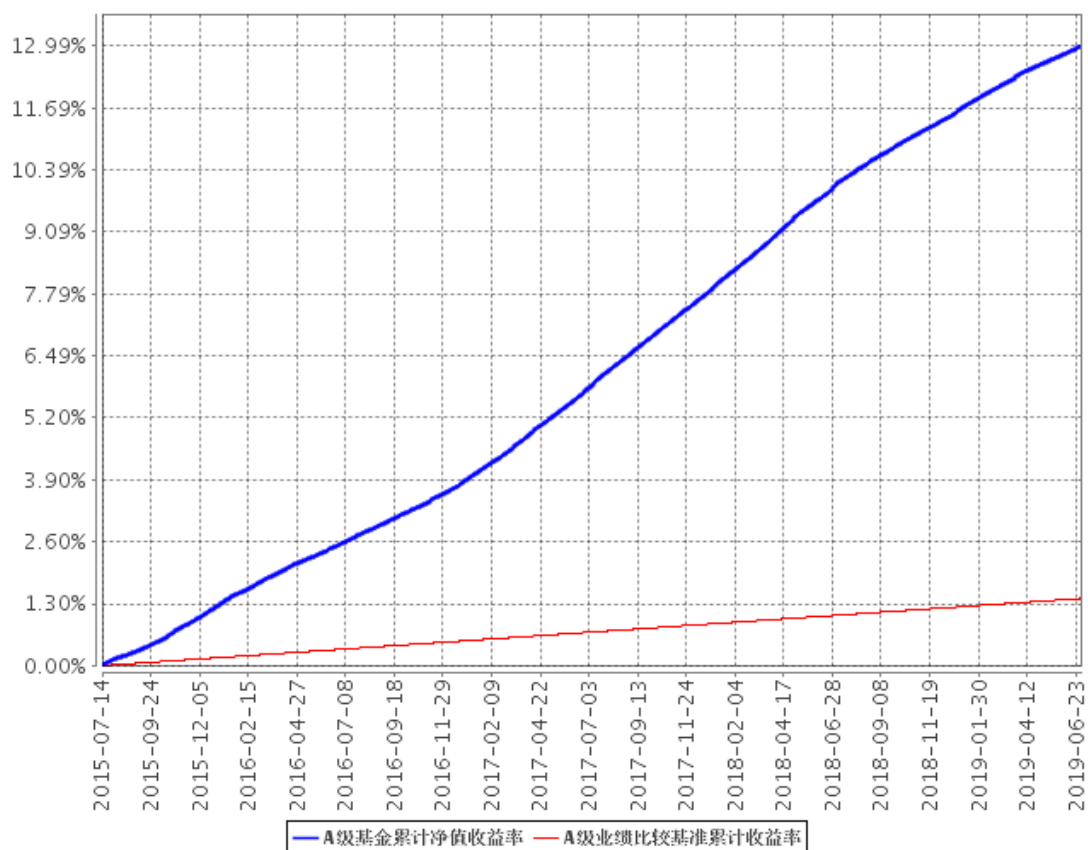
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去6个月	0.6756%	0.0037%	0.1760%	0.0000%	0.4996%	0.0037%
2018年	3.3519%	0.0035%	0.3549%	0.0000%	2.9970%	0.0035%
2017年	3.1164%	0.0052%	0.3549%	0.0000%	2.7615%	0.0052%
份额增设日（2016年2月26日）至2016年12月31日	1.4926%	0.0036%	0.3014%	0.0000%	1.1912%	0.0036%

注：本基金于2016年2月26日新增B类份额。

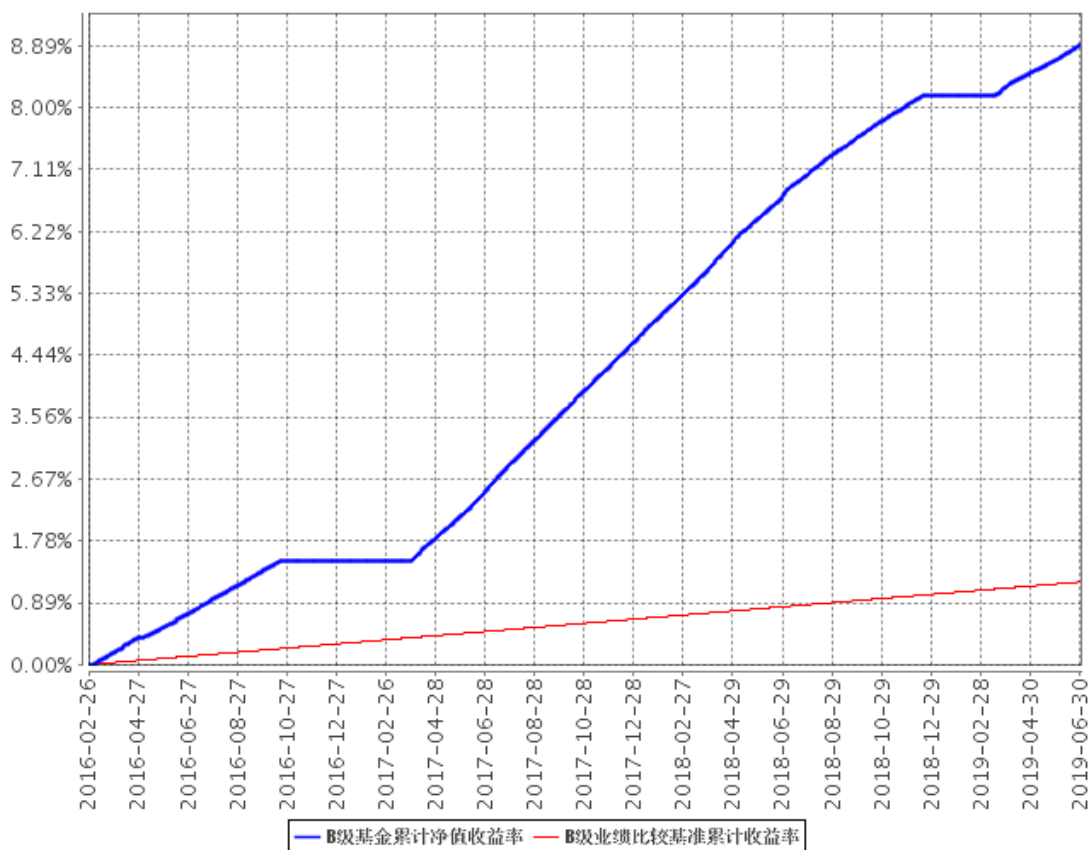
2、图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

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

**A级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**



**B级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：A级图示日期为2015年7月14日至2019年6月30日。B级图示日期为2016年2月26日至2019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、A类基金份额上市费及年费；
- 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

本基金各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，在通常情况下，本基金 A 类基金份额的销售服务费按前一日 A 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提，本基金 B 类基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金份额的基金资产净值的 0.01% 年费率计提。

各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为某类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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、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各纳税主体，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，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，依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金信息披露相关章节，并对包括基金管理人等其他信息一并更新。主要更新的内容如下：

- 1、“重要提示”部分，说明了本次招募说明书更新内容。
- 2、“基金管理人”部分，对相关信息作了更新。
- 3、“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。
- 4、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及基金合同和托管协议变更事项，对基金信息披露相关章节进行更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一九年十二月三十日