

华宝兴业现金添益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

华宝兴业基金管理有限公司

2013 年 1 月 23 日

目录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	4
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	8
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	14
七、基金财务状况.....	15
八、基金投资组合.....	17
九、基金管理人承诺.....	21
十、基金托管人承诺.....	22
十一、基金上市推荐人意见.....	23
十二、基金份额的申购与赎回.....	24
十三、备查文件目录.....	28
附件:基金合同摘要.....	29

一、重要声明与提示

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华宝兴业基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2012年12月15日刊登于《证券日报》、《证券时报》和华宝兴业基金管理有限公司网站（www.fsfund.com）的本基金招募说明书。

二、基金概览

- 1、基金二级市场交易简称：华宝添益。
- 2、二级市场交易代码：511990。
- 3、基金申购赎回简称：添益申赎。
- 4、申购赎回代码：511991。
- 5、2013年1月18日基金份额总额：18,026,280.00份。
- 6、2013年1月18日基金份额净值：100元。
- 7、本次上市交易份额：18,026,280.00份。
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 9、上市交易日期：2013年1月28日。
- 10、基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。
- 12、上市推荐人：海通证券股份有限公司。

13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：安信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。若有新增代办券商, 我司将另行公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：2012年12月10日中国证监会证监许可【2012】1651 号文。

2、基金运作方式：契约型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金自2012年12月19日起至2012年12月21日发售。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：网上现金发售3个工作日。

7、发售方式：投资者可选择网上现金认购方式。

8、发售机构

本基金的网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位：海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、西部证券股

份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。

（二）基金合同生效

截至2012年12月21日本基金募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集确认的净认购金额为1,802,628,000.00元人民币，有效认购户数为10,558户，按照每份基金份额初始面值1.00元人民币计算，本次募集资金折合基金份额总计1,802,628,000.00份。本基金有效认购资金在募集期间产生的利息在银行结息日计入基金资产，并由发行协调人划入基金托管专户，具体金额以银行实际结息金额为准。本次募集认购确认资金已于2012年12月27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华宝兴业现金添益交易型货币市场基金托管专户。本基金管理人及本基金管理人的基金从业人员没有认购本基金。

根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）等法律法规以及《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金本次募集符合有关条件，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2012年12月27日获得中国证监会的书面确认，基金合同自该日起生效。

（三）基金份额折算

根据《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》和《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金在基金合同生效当日，本基金管理人将为本基金办理份额折算，并由注册登记机构进行基金份额的变更登记。折算后每份基金份额对应的面值为100元，基金份额持有人持有的基金份额对应为折算前基金份额持有人持有的基金份额/100。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。

本基金的份额折算日为2012年12月27日。本次募集认购金额为1,802,628,000.00元，折算前基金份额总额为1,802,628,000.00份，折算前基金份额净值为1.00元。根据基金合同中约定的基金份额折算方法，本基金折算后的基金份额总额为18,026,280.00份，折算后基金份额净

值为100元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2012年12月27日进行了变更登记。投资者可以自2012年12月28日起在其上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所上证基字〔2013〕17号。

2、上市交易日期：2013年1月28日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：华宝添益。

5、二级市场交易代码：511990。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、基金申购赎回简称：添益申赎。

7、申购赎回代码：511991。

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括安信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

8、本次上市交易份额：18,026,280.00份。

9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2013年1月18日，本基金份额持有人户数为10,558户，平均每户持有的基金份额为1,707份。

（二）持有人结构

截至2013年1月18日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为10,661,170份，占基金总份额的59.14%；个人投资者持有的基金份额为7,365,110份，占基金总份额的40.86%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2013年1月18日：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	华宝信托有限责任公司—单一类资金信托R2	3,600,000.00	19.97%
2	海通证券股份有限公司	2,000,000.00	11.09%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普	2,000,000.00	11.09%
4	华宝投资有限公司	500,000.00	2.77%
5	申银万国证券股份有限公司	500,000.00	2.77%
6	银河证券—光大—银河安心收益1号集合资产	500,000.00	2.77%
7	光大证券股份有限公司	499,980.00	2.77%
8	江海证券有限公司	200,000.00	1.11%
9	中信证券股份有限公司	200,000.00	1.11%
10	东兴证券—工行—东兴2号优质成长集合资产	150,000.00	0.83%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：华宝兴业基金管理有限公司

2、法定代表人：郑安国

3、总经理：裴长江

4、注册资本：1.5亿元人民币

5、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58楼

6、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会基金字[2003]19号

7、经营范围：在中国境内从事基金管理、发起设立基金；中国证监会批准的其它业务

8、股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份，外方股东法国兴业资产管理有限公司持有49%的股份。

9、内部组织结构及职能：

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设风险控制及合规委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由三位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营由总经理负责，下设投资决策委员会和内部控制委员会两个专业委员会。公司设督察长，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投研大部下设国内投资部、海外投资管理部、固定收益部、机构投资部、量化投资部、策略部及研究部。市场大部下设产品开发部、机构及海外销售部、专户销售部、营销策划部、市场支持部、电子商务部、七大投资服务中心、北京分公司及深圳分公司。营运大部下设交易部、清算登记部、财务部、信息技术部和人事行政部。此外，公司设有风险管理部、监察稽核部，由督察长协同总经理直接管理。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中，基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

10、人员情况：

截止到2012年12月31日，公司有员工180人，其中58%的员工具有硕士以上学历。

11、信息披露负责人：刘月华

电话：021-38505888

12、基金管理业务情况简介：

截至2012年12月31日，华宝兴业基金管理有限公司旗下共管理25只开放式基金，资产管理规模为376.61亿元。旗下管理的基金有华宝兴业宝康消费品证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金、华宝兴业宝康债券投资基金、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金、华宝兴业增强收益债券型证券投资基金、华宝兴业中证100指数证券投资基金、华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金、上证180价值交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、上证180成长交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证180成长交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金、华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金、华宝兴业资源优选股票型证券投资基金、华宝兴业现金添益交易型货币市场基金。

13、本基金基金经理

陈昕先生，2003年毕业于湖南大学，获经济学学士学位。2003年7月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后在清算登记部、交易部、固定收益部从事固定收益产品相关的估值、交易、投资工作，2010年7月起任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理助理，2011年11月至今任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理，2012年6月兼任华宝兴业中证短融50债券基金基金经理，2012年12月兼任华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金经理。

（二）基金托管人

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：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

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2012年9月30日，中国建设银行资产总额132,964.82亿元，较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,585.19亿元，较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%，年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元，较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%，净利息收益率为2.74%，分别较上年同期提高0.01和0.06个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元，较上年同期增长1.64%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行20家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。本集团在英国《银行家》2012年“全球银行1000强”中位列第6，较去年上升2位；在美国《财富》世界500强中排名77位，较去年上升31位；在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位，较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”的上市公司，并先后获得《环球金融》、《财资》、中国银行业协会等颁发的“中国最佳银行”、“卓越管理及公司管治”与“2011年度最具社会责任金融机构”等奖项。

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、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员

工209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

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，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。

郑绍平，投资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，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。

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、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2012年9月30日，中国建设银行已托管267只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续三年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖。

（三） 上市推荐人

海通证券股份有限公司

注册地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

服务热线：95553、400—8888—001 或拨打各城市营业网点咨询电话

联系人：李笑鸣

公司网址：www.htsec.com

（四）一级交易商

华宝兴业现金添益交易型货币市场基金（“华宝添益”）申购赎回代办券商名单如下：
安信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

（五）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233 号汇亚大厦1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路202 号普华永道中心11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：刘颖

经办注册会计师：汪棣、刘颖

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至 2013 年 1 月 18 日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
	2013 年 1 月 18 日
资 产：	
银行存款	1,712,834,398.54
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	49,896,380.23
其中：股票投资	
债券投资	49,896,380.23
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	39,200,178.80
应收证券清算款	
应收利息	6,029,016.39
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	1,807,959,973.96
负债和所有者权益	本报告期末
	2013 年 1 月 18 日
负 债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	

卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	
应付管理人报酬	311,545.71
应付托管费	80,111.74
应付销售服务费	222,532.65
应付交易费用	453.80
应交税费	
应付利息	
应付利润	208,748.89
其他负债	13,808.16
负债合计	837,200.95
所有者权益：	
实收基金	1,807,122,773.01
未分配利润	
所有者权益合计	1,807,122,773.01
负债和所有者权益总计	1,807,959,973.96

注： 本报告期自 2012 年 12 月 27 日起至 2013 年 1 月 18 日止。本基金合同于 2012 年 12 月 27 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至 2013 年 1 月 18 日，本基金的投资组合情况如下：

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	49,896,380.23	2.76
	其中：债券	49,896,380.23	2.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	39,200,178.80	2.17
	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	1,712,834,398.54	94.74
4	其他资产	6,029,016.39	0.33
5	合计	1,807,959,973.96	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	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况：

截至 2013 年 1 月 18 日，本基金未出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

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	21
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	37

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21
-------------------	----

(2) 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况说明

截至 2013 年 1 月 18 日，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	85.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	8.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天 (含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	99.71	-

4 、报告期末按券种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	49,896,380.23	2.76
	其中：政策性金融债	49,896,380.23	2.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-

8	合计	49,896,380.23	2.76
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名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	120228	12 国开 28	500,000	49,896,380.23	2.76

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	0.0005%
报告期内偏离度的最低值	0.0003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0001%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至 2013 年 1 月 18 日，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）基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

（2）截至 2013 年 1 月 18 日，本基金不存在持有的剩余期限小于 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 20%的情况。

（3）截至 2013 年 1 月 18 日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（4）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,029,016.39
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,029,016.39

九、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

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

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

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

十、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

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

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

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

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

十一、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为海通证券股份有限公司。上市推荐人与本基金管理人、基金托管人之间不存在任何关联关系。

上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十二、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的开放日及时间

1、申购与赎回的开始时间

自 2013 年 1 月 28 日起，本基金开始办理申购、赎回业务。

2、开放日及开放时间

投资人可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日, 开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。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。

（二）申购和赎回场所

投资者应当在一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金一级交易商包括：安信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

（三）申购和赎回的数额限制

1、本基金申购和赎回的数额限制为：申购和赎回为 10 份或 10 份的整数倍。

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、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购份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体上公告并报中国证监会备案。

（四）申购和赎回的原则

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”的方式，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，为投资者每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户。投资者赎回基金份额时，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，则从投资者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；

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法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体上公告。

（五）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。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、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，本基金注册登记机构在 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。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的销售机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

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。

（六）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作。
2. 证券交易所或其他投资标的的交易市场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。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 基金管理人认为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形。
7. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项以外的暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。

(七) 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无法正常运作。
2. 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。
3. 当日超出基金管理人规定的总量控制的赎回申请。
4. 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。
5. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生除上述 3 以外的其他情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，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。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予以公告。

(八) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2. 上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个开放日的每百份基金已实现收益和七日年化收益率。

3. 基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒体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。

十三、备查文件目录

- （一）中国证监会核准华宝兴业现金添益交易型货币市场基金募集的文件
- （二）《华宝兴业现金添益交易型货币市场基金基金合同》
- （三）《华宝兴业现金添益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、营业执照和公司章程
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

华宝兴业基金管理有限公司

2013 年 1 月 23 日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及其权利义务

（一）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）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、非交易过户等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率、管理费率、销售服务费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（8）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换销售机构，并依据基金销售服务协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）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；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

(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；

(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) 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) 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；

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

(13) 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；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(18) 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；

(19) 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；

(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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人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托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 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；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 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收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

(8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

（四）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

(1) 安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，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) 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；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；

(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应予保密，不得向他人泄露；

(8) 对基金财务会计报告、中期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；

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(10) 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；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 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；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

(16) 按照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自行召集基金份额持有人大会；

(17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 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；

(20) 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业监督管理机构，并通知基金管理人；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其它义务。

（五）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其它权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（六）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在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；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

(二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10% 以上(含 10%，下同)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)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 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的除外；
- (8) 提高销售服务费率，但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- (9) 本基金与其他基金的合并；
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
- (12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，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、销售服务费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率

的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；

(3)因相应的法律法规、上海证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5)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；

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2.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，应当自行召集。

3.代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

4.代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5.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。

(四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1)会议召开的时间、地点和出席方式;
- (2)会议拟审议的主要事项;
- (3)会议形式;
- (4)议事程序;
- (5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- (6)代理投票的授权委托书的内容要求(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;
- (7)表决方式;
- (8)会务常设联系人姓名、电话;
- (9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (10)召集人需要通知的其他事项。

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

3.如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面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书面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书面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,不影响计票和表决结果。

(五)基金份额持有人出席会议的方式

1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采

用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(5)会议的召开方式由召集人确定。

2.召开基金份额持有人大会的条件

(1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

(2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4)本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

5)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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

(六)议事内容与程序

1.议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3)对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3.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。

(七)决议形成的条件、表决方式、程序

1.基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2.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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4.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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.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。

(八)计票

1.现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2. 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。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决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。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。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益与分配

(一)基金收益的构成

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

(二)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，记入投资人收益账户，免收再投资的费用。投资人收益账户里的权益和其本金（投资人基金份额）一起参加当日的收益分配，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. 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
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；
7. 投资者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. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(三)收益分配方案

基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核。

(四) 收益分配的公告和实施

本基金每工作日进行收益分配。每开放日公告前一个开放日基金份额的每百份基金已实现收益及七日年化收益率。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。

四、基金的费用

(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. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 基金上市费及年费；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.09% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

3. 基金销售服务费

本基金的销售服务费年费率为 0.25%，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 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

4. 除管理费、托管费、销售服务费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生

的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资目标

保持本金的安全性和基金财产的流动性，追求高于比较基准的稳定收益。

(二)投资范围

本基金的投资范围包括：

1. 现金；
2. 通知存款；
3. 短期融资券；
4. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；
5. 1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；
6. 期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；
7. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；
8. 期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；
9. 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）中期票据；
10. 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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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

本基金通过对短期金融工具的积极稳健投资,在保持本金安全与资产充分流动性的前提下,追求稳定的现金收益。主要投资策略如下：

1. 久期策略

基于对宏观经济环境的深入研究,预期未来市场利率的变化趋势,结合基金未来现金流的分析,确定投资组合平均剩余期限,把握买卖时机。如果预测未来利率将上升,则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险,相反,如果预测未来利率下降,则延长组合平均剩余期限,赚取利率下降带来的超额回报。本基金的平均剩余期限控制在 120 天以内。

2.收益率曲线策略

收益率曲线策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合,将预期到的变动资本化。其中有三种方式可以选择:子弹策略是将偿还期限高度集中于收益率曲线上的某一点;哑铃策略是将偿还期限集中于曲线的两端,即重点投资于期限较短的债券和期限较长的债券,弱化中期债的投资;而梯形策略是当收益率曲线的凸起部分均匀分布时,集中投资于这几个凸起部分所在年期的债券。

3.类属配置策略

类属配置策略主要实现两个目标:一是通过类属配置满足基金流动性需求,二是通过类属配置获得投资收益。本基金将根据各品种(国债、金融债、央行票据、回购、短期融资券、现金等)的市场规模、交易活跃程度、相对收益、信用等级、平均到期期限等重要指标来确定各类资产的配置比例。再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

4.套利策略

由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异,以及资金供求失衡导致的中短期利率异常差异,使得债券现券市场上存在着套利机会。无风险套利主要包括银行间市场、交易所市场的跨市场套利和同一交易市场中不同品种的跨品种套利。基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会,进行跨市场、跨品种操作,以期获得安全的超额收益。

5.逆回购策略

基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致的短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金拆借利率陡升的投资机会。

6.现金流管理策略

本基金作为现金管理工具,必须具备较高的流动性。投资运作中本基金将采用均衡分布、滚动投资、优化期限配置等方法,加强流动性管理。基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素,对投资组合的现金比例进行结构化管理。同时,也会通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整并有效分配基金的现金

流，保持本基金的充分流动性。

(四)投资程序

1.公司研究部通过内部独立研究，研究人员根据市场公开披露的信息及专业机构提供的研究报告，对市场利率的预期变动进行分析；跟踪、监测市场上各类金融投资工具的收益率变动，并据此提出投资建议。

2.在投资决策委员会的指导下，基金经理小组综合对国内外宏观经济、货币政策、货币市场发展趋势等要素的分析判断，按照基金合同规定，提出下一阶段本基金类属资产配置比例。

3.投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略，审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4.基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议，参考本公司研究部和其他研究机构的研究报告，选择具体的投资目标，构建投资组合并负责日常基金管理。

5.设置集中交易室，基金经理将投资指令下达给集中交易室，交易主管在复核投资指令合法合规的基础上，将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

6.内控审计风险管理部对基金投资过程进行日常监督。

7.基金经理小组将跟踪货币市场的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

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作出调整。

(五)业绩比较基准

本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

(六)风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

(七)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：

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

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

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、资产支持证券、中期票据的剩余期限以计算日至中央银行票据、资产支持证券、中期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。

(八)投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天;

(2)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 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%;

(5)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;

(6)投资于同一公司发行的短期企业债券和短期融资券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

(7)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%;

(8)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;

(9)买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天;

(10)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;本基金持有的同一(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)本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上(含 AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3

个月内予以全部卖出；

(12) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

A、国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

B、根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：

A) 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；

B) 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。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；

(13) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除第（7）、（11）、（12）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。对于第（7）项，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。

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。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. 本基金不得投资于以下金融工具：

(1) 股票、权证；

(2) 可转换债券；

(3) 剩余期限超过 397 天的债券；

(4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；

(5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；

(6) 非在全国银行间债券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，基金管理人履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

3.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或者提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；
- (7)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；
- (8)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (9)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。

（九）基金管理人代表基金行使证券权利的处理原则及方法

- 1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使证券权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2.有利于基金财产的安全与增值；
- 3.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（十）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

六、基金资产净值的计算方式和公告方式

（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、银行存款本息、基金应收申购款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负债后的价值。

(三)基金资产净值公告、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;

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、基金份额发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报刊和网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

- 1.基金份额持有人大会决定终止的;
- 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
- 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
- 4.中国证监会规定的其他情况。

(二)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

4. 基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清

算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同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。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前,将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。