

# 金鹰现金增益交易型 货币市场基金 E 类份额上市交易公告书

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

E类份额注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市推荐人：招商证券股份有限公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2017年4月10日

公告日期：2017年3月31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 .....	10
五、基金主要当事人简介 .....	12
六、基金合同摘要 .....	17
七、基金财务状况 .....	18
八、基金投资组合 .....	20
九、重大事件揭示 .....	25
十、基金管理人的承诺 .....	26
十一、基金托管人承诺 .....	27
十二、基金上市推荐人意见 .....	28
十三、备查文件目录 .....	29
附件：金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同内容摘要 .....	31

## 一、重要声明与提示

《金鹰现金增益交易型货币市场基金 E 类份额上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，金鹰现金增益交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）基金管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人招商证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者阅读 2017 年 3 月 2 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本公司指定销售机构网站上的《金鹰现金增益交易型货币市场基金招募说明书》。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：金鹰现金增益交易型货币市场基金
- 2、份额类别：本基金设三类基金份额，A类和B类为场外基金份额，E类为场内基金份额
- 3、基金二级市场交易简称：金鹰增益
- 4、二级市场交易代码：511770
- 5、基金场内申购、赎回简称：金鹰增益
- 6、场内申购、赎回代码：511771
- 7、截至公告日前两个工作日即 2017 年 3 月 29 日基金份额总额：A 类：10,180,117.35 份；B 类：185,285,905.32 份；E 类：14,934,510.00 份
- 8、截至公告日前两个工作日即 2017 年 3 月 29 日基金份额净值：A 类：1.00 元；B 类：1.00 元；E 类：100 元
- 9、本次上市交易份额（E 类基金份额）：14,934,510.00 份
- 10、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 11、上市交易日期：2017 年 4 月 10 日
- 12、基金管理人：金鹰基金管理有限公司
- 13、基金托管人：招商证券股份有限公司
- 14、上市推荐人：招商证券股份有限公司
- 15、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：安信证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、江海证券有限公司、山西证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、太平洋证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一) 本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2016 年 11 月 23 日证监许可[2016]2827 号。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2017 年 3 月 6 日至 2017 年 3 月 10 日，通过场外认购和场内认购两种方式公开发售。场外认购的发售日期为 2017 年 3 月 6 日至 2017 年 3 月 10 日；网下现金认购的发售日期为 2017 年 3 月 6 日至 2017 年 3 月 10 日，网上现金认购的发售日期为 2017 年 3 月 8 日至 2017 年 3 月 10 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：网下现金认购 5 个工作日，网上现金认购 3 个工作日。

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

8、发售机构：

场外认购：

(1) 直销机构

金鹰基金管理有限公司

(2) 代销机构

财通证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、宁波银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中信期货有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、大同证券有限责任公司、宏信证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、西南证券股份有限公

司、金元证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、嘉实财富管理有限公司、开源证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、中邮证券有限责任公司、广州证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、海通证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、天风证券股份有限公司

场内认购：

(1) 发售协调人

招商证券股份有限公司

(2) 网下现金认购的直销机构

金鹰基金管理有限公司

(3) 网下现金认购的发售代理机构

财通证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、中邮证券有限责任公司、广州证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、海通证券股份有限公司

(4) 网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：

高盛高华证券有限责任公司，光大证券股份有限公司，广发证券股份有限公司，广州证券股份有限公司，国都证券股份有限公司，国海证券股份有限公司，国金证券股份有限公司，国开证券有限责任公司，国联证券股份有限公司，国融证券股份有限公司，国盛证券有限责任公司，国泰君安证券股份有限公司，国信证券股份有限公司，国元证券股份有限公司，海际证券有限责任公司，海通证券股份有限公司，恒泰长财证券有限责任公司，恒泰证券股份有限公司，宏信证券有限责任公司，红塔证券股份有限公司，华安证券股份有限公司，华宝证券有限责任公司，华创证券有限责任公司，华福证券有限责任公司，华金证券有限责任公司，华林证券股份有限公司，华龙证券股份有限公司，华融证券股份有限公司，

华泰联合证券有限责任公司，华泰证券股份有限公司，华西证券股份有限公司，华英证券有限责任公司，华菁证券有限公司，华鑫证券有限责任公司，江海证券有限公司，金通证券有限责任公司，金元证券股份有限公司，九州证券股份有限公司，开源证券股份有限公司，联储证券有限责任公司，联讯证券股份有限公司，民生证券股份有限公司，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司，南京证券股份有限公司，平安证券股份有限公司，瑞信方正证券有限责任公司，瑞银证券有限责任公司，山西证券股份有限公司，上海华信证券有限责任公司，上海证券有限责任公司，申港证券股份有限公司，申万宏源西部证券有限公司，申万宏源证券承销保荐有限责任公司，申万宏源证券有限公司，世纪证券有限责任公司，首创证券有限责任公司，太平洋证券股份有限公司，天风证券股份有限公司，万和证券股份有限公司，万联证券有限责任公司，网信证券有限责任公司，五矿证券有限公司，西部证券股份有限公司，西藏东方财富证券股份有限公司，西南证券股份有限公司，湘财证券股份有限公司，新时代证券股份有限公司，信达证券股份有限公司，兴业证券股份有限公司，银泰证券有限责任公司，英大证券有限责任公司，招商证券股份有限公司，浙商证券股份有限公司，中德证券有限责任公司，中国国际金融股份有限公司，中国民族证券有限责任公司，中国银河证券股份有限公司，中国证券金融股份有限公司，中国中投证券有限责任公司，中航证券有限公司，中山证券有限责任公司，中泰证券股份有限公司，中天证券股份有限公司，中信建投证券股份有限公司，中信证券(山东)有限责任公司，中信证券股份有限公司，中银国际证券有限责任公司，中邮证券有限责任公司，中原证券股份有限公司

以上排名不分先后，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。

9、验资机构名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况：本基金根据中国证监会证监许可[2016]2827号文批准，自2017年3月6日起公开募集，截止2017年3月10日，基金募集工作已顺利结束。经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为1,688,615,680.38元人民币，折合基金份额1,688,615,680.38份；经基金登记结算机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计2,050.82元人民币，折合基金份额2,050.82份，归基金份额持有人所有；网上

现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息归入基金财产。募集资金已于2017年3月16日划入本基金在基金托管人招商证券股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为4716户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计1,688,617,731.20份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金0份，占基金总份额0%。

11、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同》、《金鹰现金增益交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2017年3月20日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

## （二）基金份额折算

根据《金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同》和《金鹰现金增益交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，金鹰现金增益交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）在基金合同生效当日，金鹰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）将为本基金E类基金份额办理份额折算，并由登记机构进行E类基金份额的变更登记。折算后E类基金份额持有人持有的基金份额=折算前E类基金份额持有人持有的基金份额/100，折算后E类基金份额对应的面值为100.00元。E类基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后基金份额持有人所持有的基金份额的净值占基金资产净值的比例不发生变化，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。本基金基金合同于2017年3月20日生效。本基金的份额折算日为基金合同生效当日。本次募集E类基金份额的认购金额为1,493,451,000.00元，折算前E类基金份额总额为1,493,451,000.00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E类基金份额总额为14,934,510.00份，折算后基金份额净值为100.00元。本公司已根据上述折算比例，对E类基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结



算有限责任公司上海分公司于 2017 年 3 月 20 日进行了变更登记。

(三) 本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2017】80 号

2、上市交易日期：2017 年 4 月 10 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

4、基金二级市场交易简称：金鹰增益

5、二级市场交易代码：511770

6、基金申购、赎回简称：金鹰增益

7、申购、赎回代码：511771

本基金管理人自 2017 年 4 月 10 日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金 E 类基金份额的申购和赎回。

目前本基金 E 类基金份额的一级交易商包括：安信证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、江海证券有限公司、山西证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、太平洋证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司

上述排名不分先后，本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时公告。

8、本次上市交易份额（E 类基金份额）：14,934,510.00 份

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

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）场内持有人户数

截至 2017 年 3 月 29 日，本基金场内份额持有人户数为 4626 户，平均每户持有的基金份额为 3,228.39 份。

### （二）场内持有人结构

截至 2017 年 3 月 29 日，本基金场内份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为 4,780,200.00 份，占基金场内总份额的 32.01%；个人投资者持有的场内基金份额为 10,154,310.00 份，占基金场内总份额的 67.99%。

### （三）前十名场内基金份额持有人情况

截至 2017 年 3 月 29 日，前十名场内基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金场内总份额的比例 (%)
1	锦州银行股份有限公司-锦州银行“7777 理财”-创赢 1204 期 35 天人民币理财产品	2,000,000.00	13.39%
2	广东逸信基金管理有限公司-逸信智富 1 号基金	600,000.00	4.02%
3	华润深国投信托有限公司-景林点金 2 号集合资金信托计划	260,000.00	1.74%
4	北京和合源资产管理有限公司-和合源金投 1 号私募证券投资基金	200,000.00	1.34%
5	方正证券股份有限公司	150,000.00	1.00%
6	广东粤财信托有限公司-瑞天	120,000.00	0.80%
7	上海勤远投资管理中心(有限合伙)-勤远动态平衡 1 号基金	100,000.00	0.67%
8	长安国际信托股份有限公司-长安信托·稳健 40 号(茂典 4 期)集合资金信托计划	77,000.00	0.52%

9	上海金箬投资管理有限公司—金箬巴旗1号私募证券投资基金	72,000.00	0.48%
10	中海信托股份有限公司—中海—浦江之星232号—茂典20号集合资金信托	60,000.00	0.40%
	合计	3,639,000.00	24.37%

(四) 截止到2017年3月29日,基金管理人的从业人员持有本基金场内份额的情况

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

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

- 1、名称：金鹰基金管理有限公司
- 2、法定代表人：凌富华
- 3、总经理：刘岩
- 4、注册资本：2.5 亿元人民币
- 5、注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基金字[2002]97 号
- 7、统一社会信用代码：9144000074448348X6
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
- 9、存续期间：持续经营
- 10、股东及其出资比例：

发起人名称	出资额（万元）	出资比例
广州证券股份有限公司	12250	49%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	20%
美的集团股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	100%

### 11、内部组织结构及职能：

权益投资部：负责公司旗下权益类公募产品或投资组合的投资管理工作；

固定收益部：负责公司固定收益证券的研究、投资工作；

研究部：负责宏观经济和政策、证券市场和上市公司的动态分析和研究, 为权益类基金投资提供研究支持；

指数及量化投资部：负责量化投资产品或投资组合的投资管理；

专户投资部：负责公司旗下权益类专户产品的研发及投资管理工作；

零售业务部：负责公司零售业务渠道的开拓、维护及管理；负责公司公募基金产品营销方案的策划、制定、效果评估，以及宣传材料的设计、制作和定期更新；

机构业务部：负责公司机构业务渠道（包括券商代销、保险公司、信托公司、财务公司及券商资产管理、自营部门等）的开拓、维护及管理；负责公司特定客户资产管理业务的开拓、维护及日常运作管理；

电子商务部：负责公司电子商务平台（包括公司网站、微信等）建设，并根据公司各项业务发展情况不断完善其功能；负责公司电子商务销售渠道的开拓、维护及管理；

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

集中交易部：负责执行公司既定的各基金的投资指令并及时反馈市场信息；

基金事务部：负责公司各类产品的日常估值、交易清算维护、头寸核算管理等；按照证券投资基金核算办法的要求，对基金的各项交易活动进行会计处理；

信息技术部：负责公司信息系统的规划、建设、维护和管理，保障公司信息系统安全运行；负责公司信息技术硬件和软件的选型、购置、开发及管理等工作；

合规风控部：负责拟定、组织实施公司风险战略；对公司投资进行实时风险监控和管理，对受托管理的各投资组合安排风险管理计划和工作报告、总结等；对新产品、新业务等提出风险管理专业意见，并组织、监督解决方案的实施；负责公司各项内部控制制度建设，统筹建设公司制度管理体系，并对各项制度执行情况评价；对公司各类业务运作进行监督、监察和审计，对发现的问题进行监督整改；

财务管理部：负责公司的财务管理工作，包括但不限于日常核算管理、内部费用管理、资金管理以及公积金管理等；

综合管理部：负责公司员工的聘用、考核、奖惩、任免、培训、调动、解聘、辞退、企业文化建设等具体的人力资源管理事宜；

北京分公司：主要负责北方地区的基金销售业务；

上海分公司：主要负责华东地区的基金销售业务；

广州分公司：主要负责华南地区的基金销售业务；

成都分公司：主要负责西南地区的基金销售业务；

12、人员情况截至 2016 年 12 月 31 日，公司共有员工 144 人，其中，博士占比 6%，硕士占比 56%，本科占比 36%，其他占比 2%。

13、信息披露负责人及咨询电话

苏文锋，020-83282627

#### 14、本基金基金经理

刘丽娟女士，曾任恒泰证券股份有限公司债券交易员、投资经理，广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监，2014年12月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。2015年7月起任金鹰货币市场证券投资基金基金经理。2016年7月起任金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)基金经理。2016年8月19日起任金鹰添益纯债债券型证券投资基金基金经理。2016年10月起任金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年2月起任金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金基金经理。2017年2月起任金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月起任金鹰添荣纯债债券型证券投资基金，金鹰添惠纯债债券型证券投资基金基金经理。

#### (二) 基金托管人情况

##### 1、基本情况

名称：招商证券股份有限公司（简称招商证券）

住所：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

成立日期：1993年8月1日

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]78号

注册资本：人民币58.0814亿元

存续期间：持续经营

联系人：秦湘

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有200家批准设立的证券营业部和11家证券经纪业务管理分公司，同时在香港

设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

## 2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人具备丰富的证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

## 3、基金托管业务经营情况

招商证券托管部是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2016 年四季度，招商证券共托管 20 只公募基金。

招商证券托管部于 2015 年 4 月通过了普华永道会计师事务所提供的 ISAE3402 鉴证服务，成为业内第一家通过 ISAE3402 认证的券商托管人和基金外包服务机构。

### （三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：费琳

电话：(021) 68419135

传真：(021) 68870311

(四) 验资机构

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层

法定代表人：石文先

联系电话：027-86770549

传真：027-85424329

邮编：430077

联系人：王兵、赵会娜



## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 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，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项 本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金2017年3月29日资产负债表如下：

资产	2017年3月29日	负债和所有者权益	2017年3月29日
	余额		余额
资产：		负债：	
银行存款	209,275,177.5	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	89,463,453.37	卖出回购金融资产款	70,000,000.00
其中：股票投资		应付证券清算款	38,808.51
债券投资	89,463,453.37	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	116,700.60
基金投资		应付托管费	33,343.04
衍生金融资产		应付销售服务费	74,683.39
买入返售金融资产	1,461,935,000.00	应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	1,112,913.99	应付利息	13,975.67
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	9,094.00

其他资产		负债合计	70,286,605.21
		所有者权益:	
		实收基金	1,691,499,939.65
		未分配利润	
		所有者权益合计	1,691,499,939.65
资产合计	1,761,786,544.86	负债与持有人权益 总计:	1,761,786,544.86

## 八、基金投资组合

截止到2017年3月29日，本基金的投资组合如下：

### （一）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	89,463,453.37	5.08
	其中：债券	89,463,453.37	5.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,461,935,000.00	82.98
	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	209,275,177.50	11.88
4	其他资产	1,112,913.99	0.06
5	合计	1,761,786,544.86	100.00

### （二）报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.55	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	70,000,000.00	4.14
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中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基金资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

### （三）基金投资组合平均剩余期限

#### 1、投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	28
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	29
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

#### 2、报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	82.48	4.14
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	4.49	0
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	11.2	0
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	5.91	0
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
合计		104.08	4.14

#### （四）报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

(五) 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	89,463,453.37	5.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	89,463,453.37	5.29
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

(六) 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	020169	17 贴债 13	900,000.00	89,463,453.37	5.29

(七) “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	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	-0.0033%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0017%
------------------------	---------

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

#### (八)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

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### (九)投资组合报告附注

##### 1、基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

(2) 基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

(3) 基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

2、本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

##### 3、其他各项资产构成

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	1,112,913.99
4	应收申购款	-

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1, 112, 913. 99

4、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人的承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

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

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

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

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

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

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

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为招商证券股份有限公司。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。

### 十三、备查文件目录

(一) 本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会准予金鹰现金增益交易型货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同》；
- 3、《金鹰现金增益交易型货币市场基金托管协议》；
- 4、关于申请募集注册金鹰现金增益交易型货币市场基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

风险提示：投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。投资者投资于本基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

金鷹基金管理有限公司

2017年3月31日

## 附件：金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### （一）基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利和义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东与债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 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；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者



实施其他法律行为；

(15) 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；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，各类基金份额的每万份或者每百份基金已实现收益和7日年化收益率；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不

向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利和义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）依法提议召开或召集基金份额持有人大会；

（5）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（6）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的每万份

或者每百份基金已实现收益和 7 日年化收益率；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》和《托管协议》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## **二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。由于 A 类和 B 类基金份额的初始面

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

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

#### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（法律法规、中国证监会及基金合同另有规定的除外）：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费费率；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- （9）变更基金份额持有人大会程序，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （13）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；
- （14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额

持有人大会的事项。

2、在不违反法律法规规定和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 在法律法规规定或中国证监会许可的范围内基金推出新业务或服务；
- (6) 按照本基金合同的约定，变更业绩比较基准；
- (7) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式；
- (8) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，对基金份额进行折算；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求

召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连



续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

### (六) 表决

每 100 份 A 类或 B 类基金份额等同于 1 份 E 类基金份额。每基金类别内基金份额持有人所持每份基金份额对应有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别

决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

### （七）计票

#### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

#### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代

表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人在履行适当程序并提前公告后，可对本部分内容进行修改和调整。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。
- 3、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资者记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益；
- 4、本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每日进行支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；若投资者在当日收益支付时，其当日净收益为

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

5、本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，计入投资者收益账户，投资者收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配，若投资者收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应场内基金份额。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；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，以现金支付给投资者；若累计收益为负值，则从投资者赎回基金款中按比例扣除。投资者卖出部分基金份额时，不支付对应的收益；但投资者份额全部卖出时，以现金方式将全部累计收益与投资者结清；

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对应的收益自下一个工作日起，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。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

### （三）收益分配方案

本基金按日计算并分配收益，基金管理人另行公告基金收益分配方案。

### （四）收益分配的时间和程序

本基金按日计算并进行收益分配。每个开放日公告前一个开放日各类基金份

额的每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的每万份或每百份基金已实现收益和节假日最后一日的7日年化收益率，以及节假日后首个开放日的每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金每日例行的收益结转不再另行公告。

(五)本基金各类基金份额的每万份或每百份基金已实现收益及7日年化收益率的计算见本基金合同第二十部分。

#### 四、基金的税收与费用

##### (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、基金的销售服务费；
- 4、E类基金份额上市费及年费；
- 5、E类基金份额注册登记TA服务费；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 7、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金的证券交易及结算费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、基金的账户开户费用和账户维护费用；
- 12、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0.28%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

## 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 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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。

## 3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等费用。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%；本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%；本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%。对于由 B 类降为 A 类的基金份额，年销售服务费率应自其降级后的下一工作日起适用 A 类基金份额的费率。对于由 A 类升为 B 类的基金份额，年基金销售服务费率应自其升级后的下一工作日起享受 B 类基金份额的费率。E 类基金份额不适用基金份额升降级规则。各类基金份额的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 为每日该类基金份额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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，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。

上述“一、基金费用的种类”中第 4、5 项费用，由基金托管人根据有关法律及相应协议的规定，按实际支出金额支付，由 E 类基金份额持有人承担。第 6—12 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、基金的投资

### （一）投资目标

在严格控制风险和保持流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益。

### （二）投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内(含一年)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。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，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

本基金结合“自上而下”和“自下而上”的研究方法对各类可投资资产进行



合理的配置和选择。本基金将综合宏观经济运行状况，货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，预测市场利率水平变动趋势，并审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益，具体投资策略包含以下几个层面：

### 1、整体资产配置策略

首先根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断，然后形成利率动态预期，进而调整本基金投资组合的平均剩余期限。

#### (1) 利率分析策略

本基金通过对通货膨胀、GDP 增长、货币供应量、国际利率水平、汇率、政府宏观政策导向等因素进行分析，形成对基本面的宏观研判。同时，对中国人民银行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金等微观层面的因素进行考察，合理预期货币市场利率曲线动态变化，以此决定基金投资组合平均剩余期限。

#### (2) 久期管理策略

当预期市场利率上升时，基金管理人将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；在预期市场收益率下降时，通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。

### 2、类属配置策略

本基金将合理配置各类短期金融工具，如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种，通过类属配置满足基金流动性需求并获得投资收益。本基金将对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析，在高流动性资产和流动性较低资产之间寻找平衡，以满足组合的日常流动性需求；基金管理人通过对各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素的分析来确定类属配置比例，选择具有投资价值的品种，以获取较高回报。

### 3、债券类资产配置策略

本基金以安全性为第一考量，优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券

品种以回避信用违约风险。本基金还可配置外部信用评级等级较高（符合法规规定的级别）的企业债、短期融资券等信用类债券。在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，客观分析收益率出现偏离的原因，寻找收益率明显偏高的券种。本基金将重点关注价格被低估品种。

#### 4、流动性管理策略

本基金将对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进行跟踪，对投资组合的现金比例进行结构化管理，使得基金具备较高的流动性。基金管理人将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，将回购或债券的到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的变现需求。

#### 5、逆回购策略

基金管理人将密切关注由于季节性需求、新股申购等原因导致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利率陡升的投资机会。

#### 6、套利策略

本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证，积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会，通过跨市场、跨品种、跨期限等套利策略，力求获得安全的超额收益。

#### 7、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

本基金不得投资于以下金融工具：

- （1）股票；
- （2）可转换债券、可交换债券；
- （3）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；
- （4）信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；

(5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

(2) 本基金持有的一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(4) 本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；

(5) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；

(6) 本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%；

(7) 本基金投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%；

(8) 本基金应当保持足够比例的流动性资产以应对潜在的赎回要求，其投资组合应当符合下列规定：

1) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

2) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；

3) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；

4) 除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不

得超过 20%;

(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%; 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%; 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的 10%; 本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(10) 本基金投资的资产支持证券不得低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级; 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, 本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金净资产的 40%; 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(12) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(13) 法律法规或中国证监会规定的其他比例限制。

因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资不符合以上规定的比例的, 除上述第(1)条、第(8)条第1)项、第(10)条外, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。如果法律法规或监管部门对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的, 以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 在履行适当程序后, 本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;

- (4) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

#### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率

本基金定位为现金管理工具，根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金采用七天通知存款利率（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，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场出现更加适合用于本基金的业绩比较基准，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### （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。本基金的预期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、平均剩余期限的计算公式为：

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

2、平均剩余存续期限的计算公式为：

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

其中：

投资于金融工具产生的资产包括现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、逆回购、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、资产支持证券或中国证监会允许投资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正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

### 3、各类资产和负债剩余期限的确定

(1) 银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；

(2) 银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

(3) 组合中债券的剩余期限和剩余存续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：允许投资的可变利率或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。允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算；

(4) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

(5) 中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续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和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

(8) 对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限和剩余存续期限。平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限和剩余存续期限计算方法另有规定的从其规定。

## 六、基金资产净值、每百份基金已实现收益和 7 日年化收益率计算方法和公告方式

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

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

日每万份基金已实现收益 = 当日该类基金份额已实现收益 / 当日该类基金份额总额 × 10000

7日年化收益率的计算方法：

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

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

(2) E类基金份额每百份基金已实现收益和7日年化收益率的计算方法如下：

每百份基金已实现收益和7日年化收益率的计算方法如下：

日每百份基金已实现收益 = 当日该类基金份额已实现收益 / 当日该类基金份额总额 × 100

7日年化收益率的计算方法：

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

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

各类基金份额每万份或每百份基金已实现收益采用四舍五入保留至小数点后第4位，7日年化收益率采用四舍五入保留至百分号内小数点后第3位。如果基金成立不足七日，按类似规则计算。其中，当日基金份额总额包括截至上一工作日(包括节假日)未结转份额。

2、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，通过其网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率。若遇法定节假日，于节假日结束后第2个自然日，公告节假日期间的各类基金份额的每万份或每百份基金已实现收益、节假日最后一日各类基金份额的7日年化收益率，以及节假日后首个工作日的各类基金份额的每万份或每百份基金已实现收益和7日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

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

## **七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算**

### **（一）《基金合同》的变更**

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后执行，自决议生效之日起2个工作日内在指定媒介公告。

### **（二）《基金合同》的终止事由**

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。



### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算

公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。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。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 九、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。