华泰柏瑞交易型货币市场基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
二〇一五年七月二十九日

一、重要声明与提示

华泰柏瑞交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金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,华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“本公司”)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,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2015年6月29日刊登在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站(www.huatai-ph.com)上的《华泰柏瑞交易型货币市场基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

二、基金概览

1.基金二级市场交易简称:华泰货币。
2.二级市场交易代码:511830。
3.基金申购、赎回简称:华泰货币。
4.申购、赎回代码:511831。
5.2015年7月27日基金份额总额:7,016,190份。
6.2015年7月27日基金份额净值:100元。
7.本次上市交易份额:7,016,190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:2015年8月3日。
10.基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司。
11.基金托管人:中国建设银行股份有限公司。
12.上市推荐人:恒泰证券股份有限公司。
13.申购赎回代办券商(以下简称“一级交易商”):长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、江海证券有限公司、上海证券有限责任公司、中万宏源证券有限公司、万联证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司和中国中投证券有限责任公司。

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及核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2014】936号文和中国证券监督管理委员会证券基金机构监督管理部机构部函【2015】1583号。
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2015年7月2日起至2015年7月6日公开发售。
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:网上现金认购方式。
8.发售机构
网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的96家证券公司:
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、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、诚信证券有限责任公司、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、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、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、国都证券有限责任公司、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、宏源证券股份有限公司、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、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、南京证券有限公司、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、中银万国证券股份有限公司、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、天源证券有限公司、万和证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券股份有限公司、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、招商证券股份有限公司、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、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)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、中银国际证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司和中原证券股份有限公司等。

(二)基金合同生效

截至2015年7月6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,本次募集确认的募集金额总额为701,619,000.00元人民币,折合基金份额701,619,000.00份。募集资金已于2015年7月10日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为4,920户,认购资金在募集期间产生的利息合计110,246.90元,已全部计入基金资产,归基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金从业人员没有认购本基金。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2015年7月14日获书面确认,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。

(三)基金份额折算

根据《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》、《华泰柏瑞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。

本次募集认购金额为701,619,000.00元,折算前基金份额总额为701,619,000.00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7,016,190.00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进行了变更登记。折算后基金份额采取四舍五入方法的方法计算保留到整数位,投资者可以在基金上市后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:上海证券交易所自律监管决定书[2015]313号。
2.上市交易日期:2015年8月3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:华泰货币。
5.二级市场交易代码:511830。

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:华泰货币。
7.申购、赎回代码:511831。

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:

序号	一级交易商	电话	网?? 址
1	长江证券股份有限公司	95579或4008-888-999	www.95579.com
2	德邦证券有限责任公司	400-888-8128	www.tebon.com.cn
3	东北证券股份有限公司	400-600-0686	www.nesc.cn
4	东海证券股份有限公司	95531或400-8888-588	www.longone.com.cn
5	东吴证券股份有限公司	(0512)33396288	www.dwjq.com.cn
6	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
7	光大证券股份有限公司	95525	www.ebscn.com
8	国金证券股份有限公司	400-660-0109	www.gjzq.com.cn
9	恒泰证券股份有限公司	(0471)4961259	www.cnht.com.cn
10	华宝证券有限责任公司	400-820-9898	www.cnhbstock.com
11	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
12	江海证券有限公司	400-666-2288	www.jhzq.com.cn
13	上海证券有限责任公司	400-891-8918	www.962518.com
14	申万宏源证券有限公司	95523或400-889-5523	www.swhysc.com
15	万联证券有限责任公司	400-888-8133	www.wlzq.com.cn
16	信达证券股份有限公司	400-800-8899	www.cindasc.com
17	湘财证券有限责任公司	400-888-1551	www.xcsc.com
18	兴业证券股份有限公司	400-888-8123	www.xyzq.com.cn
19	中国国际金融有限公司	(021)58796226-3736	www.cicc.com.cn
20	中国中投证券有限责任公司	400-600-8008	www.china-invs.cn

8.本次上市交易份额:7,016,190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2015年7月27日,本基金份额持有人户数为4,920户,平均每户持有的基金份额为1,426.05份。

(二)持有人结构

截至2015年7月27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6,062,940份,占基金总份额的86.41%;

个人投资者持有的基金份额为953,250份,占基金总份额的13.59%。

(三)前十名基金份额持有人的情况:

截至2015年7月27日,前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占总份额比例(%)
1	恒泰证券股份有限公司	1,000,000.00	14.25%
2	兴业证券股份有限公司	1,000,000.00	14.25%
3	中国国际金融有限公司	850,000.00	12.11%
4	湘财证券－兴业银行－湘财金禾五号集合资产管理计划	700,000.00	9.98%
5	上海证券有限责任公司	500,000.00	7.13%
6	广发证券股份有限公司	380,000.00	5.42%
7	敦化市亚联机械制造有限公司	325,810.00	4.64%
8	华宝信托有限责任公司－宝钢1号单一资金信托	300,000.00	4.28%
9	浙商证券－农行－浙商汇金1号集合资产管理计划	300,000.00	4.28%
10	信达证券股份有限公司	300,000.00	4.28%
11	湘财证券－兴业银行－湘财金禾三号集合资产管理计划	300,000.00	4.28%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1.名称:华泰柏瑞基金管理有限公司
2.注册地址:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
3.法定代表人:齐亮
4.总经理:韩勇
5.成立日期:2004年11月18日
6.批准设立机关:中国证券监督管理委员会
7.批准设立文号:中国证监会证监基金字【2004】178号
8.工商登记注册的法人营业执照文号:310000400404609
9.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
10.组织形式:有限责任公司
11.注册资本:贰亿元人民币
12.存续期间:持续经营
13.信息披露负责人:陈晖
联系电话:400-888-0001,(021)38601777
14.股权结构:PineBridge Investments LLC(柏瑞投资有限责任公司)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%。
15.内部组织结构及职能:

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险,并提出防范措施。

目前,公司下设22个部门,并在北京、深圳分别设立了分公司。

投资部:负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票投资。

专户理财部:负责专户的投资管理。

海外投资部:负责公司QDII的投资管理。

指数投资部:负责指数研究、设计和开发工作,以及进行指数产品的投资管理。

量化投资部:负责量化产品的投资管理。

研究部:负责根据投资决策委员会制定的原则进行行业和上市公司研究。

交易部:负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。

北京分公司、深圳分公司、第一营销中心、第二营销中心:负责基金销售。

机构业务一部、机构业务二部:负责机构客户的业务拓展。

市场营销部:负责对外开拓维护渠道总部,对内管理服务渠道销售人员,同时负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。

客户服务部:负责公司的客户服务。

产品与业务发展部:负责基金产品研发等新业务拓展。

基金事务部:负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

信息技术与电子商务部:负责公司信息系统的日常运行与开发。

法律监察部:负责内部法律事务咨询,处理外部法律事务,检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况,负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性,检查公司内部控制制度的执行情况,并提出改进意见。

风险管理部:负责投资、交易环节风险提示及控制,研究公司风险管理政策与方针,协调各部门处理公司层面风险事项。

人力资源部:负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。

行政管理部:负责公司后勤服务、公文档案管理。

财务部:负责公司财务事项。

16.人员情况:

截止2015年6月30日,本公司共有员工158人。其中,投资研究团队共有人员55名,取得CFA资格6名,占11%,全公司取得基金从业资格的有141人。其中,公司高级管理人员和从事研究、投资、估值、营销、监察稽核等业务的主要业务人员都已取得基金从业资格。在所有公司人员中,研究生及以上学历的占67%,本科学历的占25%。

17.基金管理业务情况简介:

截止2015年6月30日,公司共管理32只基金,包括13只股票型基金,分别是华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金和华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金;11只混合型基金,华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开开放混合型发起式证券投资基金;6只债券型基金,华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金和华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金;1只货币型基金,华泰柏瑞货币市场证券投资基金和1只QDII基金,华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金。截至2015年6月30日,公司管理的基金资产规模为人民币766.62亿元,总份额规模为503.28亿份。

18.本基金基经理

郑青女士:10年证券(基金)从业经验,经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司,2008年3月至2010年4月任中海基金管理有限公司交易员,2010年加入华泰柏瑞基金管理有限公司,任债券研究员。2012年6月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理,2013年7月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金经理。2015年1月起任固定收益部副总监。

(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
成立日期:2004年09月17日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】12号
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史,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)。

2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。

截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。

截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加821万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。

截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大:自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。

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、OFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240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

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

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、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

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2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”;获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

(三)上市推荐人

名称: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:扬子堂
电话:(0471)4974437
客服电话:(0471)4961259
公司网址:www.cnht.com.cn

(四)一级交易商

序号	一级交易商	电话	网?? 址
1	长江证券股份有限公司	95579或4008-888-999	www.95579.com
2	德邦证券有限责任公司	400-888-8128	www.tebon.com.cn
3	东北证券股份有限公司	400-600-0686	www.nesc.cn
4	东海证券股份有限公司	95531或400-8888-588	www.longone.com.cn
5	东吴证券股份有限公司	(0512)33396288	www.dwjq.com.cn
6	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
7	光大证券股份有限公司	95525	www.ebscn.com
8	国金证券股份有限公司	400-660-0109	www.gjzq.com.cn
9	恒泰证券股份有限公司	(0471)4961259	www.cnht.com.cn
10	华宝证券有限责任公司	400-820-9898	www.cnhbstock.com
11	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
12	江海证券有限公司	400-666-2288	www.jhzq.com.cn
13	上海证券有限责任公司	400-891-8918	www.962518.com
14	申万宏源证券有限公司	95523或400-889-5523	www.swhysc.com
15	万联证券有限责任公司	400-888-8133	www.wlzq.com.cn
16	信达证券股份有限公司	400-800-8899	www.cindasc.com
17	湘财证券有限责任公司	400-888-1551	www.xcsc.com
18	兴业证券股份有限公司	400-888-8123	www.xyzq.com.cn
19	中国国际金融有限公司	(021)58796226-3736	www.cicc.com.cn
20	中国中投证券有限责任公司	400-600-8008	www.china-invs.cn

(五)基金验资机构

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:单峰、张勇

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2015年7月27日的资产负债表如下:

资产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资产:		负债:	
银行存款	701618200	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	0	卖出回购金融资产款	–
其中:股票投资	0	应付证券清算款	–
债券投资	–	应付赎回款	–
资产支持证券投资	–	应付管理人报酬	82500.12
基金投资	–	应付托管费	22500.03
衍生金融资产	–	应付销售服务费	62500.09
买入返售金融资产	–	应付交易费用	0
应收证券清算款	–	应付税费	–
应收利息	834360.40	应付利息	–
应收股利	0	应付利润	48983.11
应收申购款	–	其他负债	78383.06
其他资产	1102469	负债合计	294866.41
		所有者权益:	
		实收基金	702267940.89
		未分配利润	0
		所有者权益合计	702267940.89
资产合计:	702562807.30	负债与持有人权益总计:	702562807.30

注:1.截至2015年7月27日,基金份额净值100元,基金份额总额7,016,190份。

2.本报告期自2015年7月14日起至2015年7月27日止。本基金合同于2015年7月14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2015年7月27日,本基金的投资组合情况如下:

(一)基金资产组合情况

资产	金额	占基金总资产的比例
固定收益投资	–	0.00%
其中:债券	–	0.00%
资产支持证券	–	0.00%
买入返售金融资产	–	0.00%
其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00%
银行存款和结算备付金合计	701618200	99.9075%
其他各项资产	944607.30	0.1345%
合计	702562807.30	100.0420%

(二)报告期内债券回购融资情况

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	0.00%	
	其中:买断式回购融资	0.00%	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	0.00%
	其中:买断式回购融资	–	0.00%

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2015年7月27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。

(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	9
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	22
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	9

2.报告期末投资组合平均剩余期限超过120天的情况说明

截至2015年7月27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	项目	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	99.9075%	–
	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	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	–	–
	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	–	–

(四)报告期末按权重品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	–
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	其他	–	–
8	合计	–	–
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

(五)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)	占基金资产净值的比例(%)
1	–	–	–	–	–
2	–	–	–	–	–
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–
6	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

(六)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

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

(七)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2015年7月27日,本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八)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2015年7月27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2015年7月27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	834360.40
4	应收申购款	–
5	其他应收款	110246.90
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	944607.3

九、重大事件揭示

以2015年7月14日为基金合同生效日,根据基金合同和招募说明书的有关规定,本基金进行了基金份额折算,具体内容详见“三、基金的募集与上市交易”的“(三)基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

基金管理人就本基金上市交易后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。

(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品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《基法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,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。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、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等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人恒泰证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:

(一)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;

(二)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、基金份额的申购和赎回

(一)申购和赎回的开放日及时间

1.申购与赎回的开放时间

自2015年8月3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

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

(三)申购与赎回的原则

1.“确定价”原则,即申购、赎回价格以每份基金份额净值为基准进行计算;

2.“份额申购、份额赎回”原则,即申购以份额申请,赎回以份额申请;

3.赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4.本基金根据每日基金收益情况,以每百份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,计入投资人收益账户,投资人赎回基金份额时,其对应比例的累积收益将立即结清,以现金支付给投资人;若累计收益为负值,则从投资人赎回基金份额中按比例扣除;

5.当日的申购、赎回申请在当日基金交易时间内提交后不得撤销。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(四)申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2.申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项的,申购成立;注册登记机构确认基金份额时,申购生效。若申购款项在规定时间内未全额到账,则申购不成立。若申购款项在规定时间内全额到账,而因