嘉实机构快线货币市场基金H类基金份额上市交易公告书

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2016 年1月11日
公告日期:2016年1月6日

一、重要声明与提示

《嘉实机构快线货币市场基金H类基金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,嘉实机构快线货币市场基金(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H类基金份额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,请投资者详细查阅刊登在2015年 12 月 23 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上的《关于嘉实机构快线货币市场基金增设场内份额并相应修订基金合同部分条款的公告》。本基金的基金合同同时发布在本公司网站(www.jsfund.cn)。

二、基金概览

1.基金名称:嘉实机构快线货币市场基金
A类基金份额(基金简称:嘉实机构快线货币A,基金代码:000917)
B类基金份额(基金简称:嘉实机构快线货币B,基金代码:000918)
C类基金份额(基金简称:嘉实机构快线货币C,基金代码:000919)
H类基金份额(上交所申赎简称:嘉实快线,申购、赎回代码:511961,上交所交易简称:嘉实快线,交易代码:511960)

2.基金份额总额与基金份额净值

截至2016年1月4日,本基金份额总额为26,261,855,432.86份,其中A类份额21,085,211,983.60份,B类份额 585,144,473.04份,C类份额3,591,209,163.10份,H类份额10,002,898.13份。

截至2016年1月4日,本基金A类、B类、C类基金份额净值为1.00元,H类基金份额净值为100.00元。

3.本次上市交易的基金份额及总额

本次上市交易的基金份额为嘉实机构快线货币市场基金H类份额10,002,898.13份。(截止2016年1月4日)

4.上市交易的证券交易所:上海证券交易所

5.上市交易日期:2016年1月11日

6.基金管理人:嘉实基金管理有限公司

7.基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

8.登记结算机构:本基金A类基金份额、B类基金份额、C类基金份额的登记业务由嘉实基金管理有限公司办理;本基金H类基金份额的登记业务由中国证券登记结算有限责任公司办理。

三、基金份额的募集与上市交易

(一)本基金募集情况

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证监许可【2014】1115号

2.基金合同生效日:2015年6月25日

3.运作方式:契约性开放式

4.基金合同期限:不定期

5.发售日期:2015年6月23日

6.发售价格:1.00元人民币

7.发售方式:场外认购

8.发售机构:
嘉实基金管理有限公司

9.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

10.募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为230,338,805.42元人民币,认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计0元人民币。本次募集所有资金已于2015年6月24日全额划入本基金在基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司开立的嘉实机构快线货币市场基金托管专户。

本次募集有效认购户数为25户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计230,338,805.42份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

9.本基金募集备案情况:本基金于2015年6月24日验资完毕,2015年6月24日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2015年6月25日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。

10.基金合同生效日:2015年6月25日

11.基金合同生效日的基金份额总额:230,338,805.42份。

(二)本基金H类基金份额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【2015】426 号

2.上市交易日期:2016年1月11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本基金H类基金份额的二级市场交易。

4.基金二级市场交易简称:嘉实快线

5.基金二级市场交易代码:511960

6.申购、赎回简称:嘉实快线

7.申购赎回代码:511961

投资者在本基金指定的一级交易商办理H类基金份额的申购和赎回业务。

目前,本基金H类基金份额的一级交易商包括:
光大证券股份有限公司,中国银河证券股份有限公司
本公司将依据实际情况变更申购赎回代办券商并予以公告。

8.本次上市交易份额:本基金H类基金份额10,002,898.13份(截止2016年1月4日)

9.未上市交易份额的流通规定:本基金包括场内份额与场外份额,本次上市的基金份额全部为场内份额,即H类基金份额。本基金H类基金份额上市交易后,所有的H类基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额;本基金A类、B类、C类基金份额不上市交易。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)基金份额持有情况

截至公告日前两个工作日即2016年1月4日,本基金H类基金份额持有人户数为1 户,平均每户持有的基金份额为10,002,898.13 份。

截至公告日前两个工作日即2016年1月4日, 本基金H类基金份额投资者持有基金份额10,002,898.13份。其中,机构投资者持有的H类基金份额为10,002,898.13份,占基金总份额的比例为100%;个人投资者持有的基金份额为0份,占基金总份额的比例为0%。

(二)基金份额前十名持有人情况

截至公告日前两个工作日即2016年1月4日,本基金H类基金份额前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额比例(%)
1	中国银河证券股份有限公司	10,002,898.13	100
合计		10,002,898.13	100

注:以上信息依据中国证券登记结算有限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.公司概况
名称:嘉实基金管理有限公司
法定代表人:邓红国
总经理:赵学军
注册资本:15亿元人民币
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期46层06-08单元
设立批准文号:中国证监会证监基字[1999]5号
成立日期:1999年4月25日

2.股东及其出资比例:中诚信托有限责任公司40%,立信投资有限责任公司30%,德意志资产管理(亚洲)有限公司30%。

3.内部组织结构及职能

(1)公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会,负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况,充分发挥独立董事监督职能,保护投资者利益和公司合法权益。

(2)债券投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构,由首席投资官(固定收益)、总监及资深基金经理组成,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。

(3)风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构,由公司总经理、督察长以及相关部门负责人组成,负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险,并提出防范化解措施。

(4)督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核,定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5)监察稽核部:公司管理层重视和支持监察稽核工作,并保证监察稽核部的独立性和权威性,配备了充足合格的监察稽核人员,明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6)业务部门:部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人,对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7)岗位员工:公司努力树立内控优先和风险管理理念,培养全体员工的风险防范意识,营造一个浓厚的内控文化氛围,保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度,使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任,并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4.人员情况
截至2015年9月30日,我公司共有610名员工,其中博士学位24人、硕士学位340人、学士学位230人、其他16人。

5.信息披露负责人:胡勇钦
咨询电话:010-65215588

6.基金管理业务情况
截止2015年9月30日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金,76只开放式证券投资基金,具体包括嘉实中和价值封闭、嘉实元和、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实价值优选混合、嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳健收益债券、嘉实价值优势股票、嘉实H股指数(QDII)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证企业中期国债ETF联接、嘉实主益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场双币分级债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实新金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证企融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合、嘉实低价策略股票、嘉实中证企融地产ETF联接。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

7.本基金基金经理简介

万晓西,13年证券从业经历,曾任职于中国农业银行黑龙江省分行国际业务部、市场开发处及深圳发展银行国际业务部、资金交易中心,南方基金固定收益部总监助理、百席宏观研究员,第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理,民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理。2007年6月6日至2009年10月20日任南方现金增利货币基金经理。2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任现金管理部总监,经济学硕士,中国国籍,2013年7月5日至2014年7月16日任嘉实货币基金和嘉实增强收益定期开放债券基金经理,2013年9月4日至2014年9月19日任嘉实丰益策略定期债券基金经理,2013年12月11日至今任嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金基金经理,2013年12月18日至今任嘉实活期宝货币基金经理。2014年3月17日至今任嘉实活钱包货币基金经理。2014年6月27日至今任嘉实3个月理财债券基金经理。2015年6月25日至今,任嘉实机构快线货币市场基金基金经理。

张文明,曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014年4 月加入嘉实基金管理有限公司现金管理部。硕士,具有基金从业资格。2014年8月13日至今任嘉实理财宝7天债券基金经理,嘉实1个月理财债券基金经理、嘉实3 个月理财债券基金经理,2015年7月14日至今任嘉实机构快线货币基金经理。

(二)基金托管人

1.公司概况
名称:上海浦东发展银行股份有限公司住所及办公地址:上海市中山东一路12号
成立时间:1992年10月19日
注册资本:186.5347亿元人民币
法定代表人:吉晓辉
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【2003】105号
联系人:朱萍
联系电话:(021)61618888

2.基金托管部门及主要人员情况
上海浦东发展银行经过二十年来的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持较快增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部,2005年更名为资产托管部,2013年再次更名为资产托管与养老金业务部,下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理处五个职能部门。

目前,上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

3.基金托管业务经营情况
上海浦东发展银行股份有限公司于2003年9月10日获得基金托管资格,截止到2014年12月31日,共托管国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、嘉实优质基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、国联安货币基金、银华永泰积极债券型基金、国联安中债信用债指数增强型基金、长信利众分级债券证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、中海安鑫保本混合型证券投资基金、博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金、易方达裕丰回报债券型证券投资基金、鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金、长信利众分级债券证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、中海安鑫保本混合型证券投资基金、鹏华丰泰定期开放债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、中信建投稳信定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型证券投资基金、中海医药健康产业混合型证券投资基金、北信瑞丰宣投宝货币基金、鑫元合丰分级债券型证券投资基金。托管基金资产净值总规模为368.08亿元。

(三)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
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联 系 人:洪磊
经办注册会计师:许康玮、洪磊

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
本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产列支,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
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。
本报告期自2015年10月1日起至2016年1月4日止。
截至公告当前两个工作日即2016年1月4日,本基金的资产负债表(未经审计)如下:

资产	2016年1月4日
银行存款	18,135,794,685.66
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	3,923,335,268.67
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	3,923,335,268.67
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	3,116,944,974.91
应收证券清算款	1,000,120,221.10
应收利息	72,024,718.75
应收股利	-
应收申购款	16,805,710.00
递延所得税资产	-
其他资产	80,000.00
资产总计	26,265,105,579.09
负债和所有者权益	2016年1月4日
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	1,896,650.35
应付托管费	919,279.92
应付销售服务费	117,392.51
应付交易费用	63,058.49
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	263,764.96
负债合计	3,250,146.23
所有者权益	2016年1月4日
实收基金	26,261,855,432.86
未分配利润	-
所有者权益合计	26,261,855,432.86
负债和所有者权益总计	26,265,105,579.09

八、基金投资组合

截至公告日前两个工作日即2016年1月4日,本基金的投资组合如下:

(一)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	3,923,335,268.67	14.94
	其中:债券	3,923,335,268.67	14.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,116,944,974.91	11.87
	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	18,135,794,685.66	69.05
4	其他资产	1,089,030,649.85	4.15
	合计	26,265,105,579.09	100.00

(二)报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6.96
	其中:买断式回购融资	-

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	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2)报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

(三)基金投资组合平均剩余期限

1.1.1 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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

1.1.2 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	77.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.38	-
3	60天(含)-90天	7.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	10.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	1.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.67	-

(四)报告期末按债券品种分类的债务投资组合

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	1,031,745,530.99	3.93
	其中:政策性金融债	1,031,745,530.99	3.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,333,516,318.04	8.89
6	中期票据	60,328,398.17	0.23
7	同业存单	497,745,021.47	1.90
8	其他	-	-
合计		3,923,335,268.67	14.94
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	99,926,682.62	0.38

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

(五)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	150202	15国开02	2,300,000	230,193,060.27	0.88
2	011537008	15中建材SCP008	2,200,000	220,195,503.81	0.84
3	150416	15农发16	2,000,000	200,418,977.15	0.76
4	150211	15国开11	2,000,000	200,362,096.72	0.76
5	011599500	15中油股SCP004	1,700,000	169,992,279.64	0.65
6	150206	15国开06	1,600,000	160,613,425.07	0.61
7	011599215	15新兴际华SCP001	1,300,000	130,617,346.67	0.50
8	011586008	15光明SCP008	1,200,000	120,128,602.70	0.46
9	041564026	15国电集团CP002	1,100,000	110,581,865.83	0.42
10	011519006	15国电SCP006	1,100,000	110,110,692.23	0.42

(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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0784%
报告期内偏离度的最低值	0.0074%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0328%

(七)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资产支持证券投资明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

(八)投资组合报告附注

1.1.3 1.基金计价方法说明
本基金采用固定份额净值,其中A、B、C类基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元,H类基金份额账面净值始终保持为100.00人民币元。

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,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

1.1.4 2、若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况

报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

1.1.5 3、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

1.1.6 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	1,000,120,221.10
3	应收利息	72,024,718.75
4	应收申购款	16,805,710.00
5	其他应收款	80,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	1,089,030,649.85

九、重大事件揭示

嘉实机构快线货币市场基金基金合同已于2015年6月25日正式生效,基金管理人于2015年6月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站刊登《嘉实机构快线货币市场基金基金合同生效公告》。

经中国证监会2015年12月 14 日《关于准予嘉实机构快线货币市场基金变更注册的批复》(证监许可【2015】(2926号)),嘉实机构快线货币市场基金就增加场内份额进行变更注册。本基金管理人于2015年 12 月 23 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站刊登了《关于嘉实机构快线货币市场基金增设场内份额并相应修订基金合同部分条款的公告》,本基金管理人于2015年 12 月 23日对嘉实机构快线货币市场基金增设场内份额(即H类基金份额),并对《基金合同》进行了相应修改,修改后的《基金合同》自2015年 12 月 23日起生效,自2015年 12 月 28 日起接受投资者对H类基金份额的申购和赎回。本基金H类基金份额自增设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。

本基金自2015年6月25日成立以来的相关公告参见本公司网站(www.jsfund.cn)。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理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、上海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人员进行基金的托管。

(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
本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录
下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。

(一)中国证监会核准嘉实机构快线货币市场基金募集的文件;
(二)《嘉实机构快线货币市场基金基金合同》;
(三)《嘉实机构快线货币市场基金招募说明书》;
(四)《嘉实机构快线货币市场基金托管协议》;
(五)法律意见书;
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;
(八)中国证监会要求的其他文件。

嘉实基金管理有限公司
2016年 1 月 6 日

附件:基金合同摘要

(一)基金合同当事人的权利与义务

A. 基金份额持有人的权利与义务

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)按照规定要求召开或自行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、基金服务机构提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》、《业务规则》;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,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)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;
(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定;
(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。

B. 基金管理人的权利与义务

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)依法募集基金;
(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、中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)召集基金份额持有人大会;
(6)依据《基金合同》及有关法律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,应星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、更换基金销售机构及其他基金服务机构,对基金销售机构及其他基金服务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、赎回或转换申请;
(12)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;
(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、融券;
(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,并确定相关费率;
(16)在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项,基金管理人有权代表基金份额持有人以基金资产作为担保物进行融资;
(17)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整《业务规则》,包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、定期定额投资、收益分配等方面的业务规则,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管理费率、托管费率、销售服务费率之外的基金相关费率结构和收费方式;
(18)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、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各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率;
(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)依照《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条件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,基金管理人应当将已募集资金并加计银行同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。

C. 基金托管人的权利与义务

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,如发现基金管理人有违反《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,应星报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算;
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)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、证券账户及投资所需的其他账户,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各类基金份额的基金资产净值、每万份或每百份基金净收益和七日年化收益率;
(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;如果基金管理人有未执行《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