华泰柏瑞货币市场证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

2014年第2号

本基金根据2009年4月3日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2009】280号文核准募集。本基金的基金合同于2009年5月6日正式生效。

本基金名称自2010年4月30日起,由“友邦华泰货币市场证券投资基金”更名为“华泰柏瑞货币证券投资市场基金”,基金简称为“华泰柏瑞货币,基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

重要提示

华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产。投资者购买本货币市场证券投资基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于货币市场工具,属于证券投资基金较高流动性、低风险品种。本基金基金净收益会因为宏观经济、货币政策、财政政策等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为2014年11月5日, 有关财务和业绩表现数据截止日为2014年9月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

托管人对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:华泰柏瑞基金管理有限公司
住所:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人:齐亮
成立日期: 2004年11月18日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]178号
经营范围:基金管理业务;发起设立基金;中国证监会批准的其他业务
组织形式:有限责任公司
注册资本:贰亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:汪莹白
联系电话:400-888-0001,(021)38601777

股权结构: PineBridge Investments LLC 49%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生:董事长,硕士,1994-1998年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长,1998-2001年任中央财经领导小组办公室副局长,2001年至2004年任华泰证券股份有限公司副总裁。

姜治平先生:董事,硕士,曾就职于CR&R环保公司、Unisys优利系统日本有限公司,1994年-2002年任纽约银行梅隆资产管理公司高级投资组合经理,2003年-2010年任纽约梅隆资产管理公司亚太区行政总裁,2010年-2011年任纽约梅隆银行被动投资及交易型开放式指数证券投资基金全球主管,2012年3月至今任柏瑞投资公司行政总裁。

吴祖芳先生:董事,硕士,1992年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

Rajeev Mittal先生: 董事,学士,1992年加入美国国际集团,2009—2011年担任柏瑞投资(欧洲分公司)总经理,新兴市场投资主管,全球固定收益研究团队主管和行政总裁(欧洲分公司),2011年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁(亚洲,日本除外)、总经理、新兴市场投资总管,全球固定收益研究团队主管。

韩勇先生:董事,博士,曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会,2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

朱小平先生:独立董事,硕士,1983至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生:独立董事,1977年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生:独立董事,博士,1988-1997年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师,1997-1999年任长城证券有限公司投资银行部副总经理,1999-2000年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理,2000-2001年任北京华创投资管理有限公司执行总裁,2001年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

杨科先生:独立董事,学士,2001年至今任北京市天元律师事务所律师。2010年至今任该律师事务所合伙人。

2、监事会成员

严玉珍女士: 监事长,学士,1987年1月至1988年9月任罗兵咸永道(前容永道会计)高级稽核员,1988年12月至1990年4月任香港电讯(前大东电报)管理会计,1990年5月至1996年11月任宝达证券(施罗德集团)副财务总监,1996年12月至2007年9月任施罗德投资管理(香港)有限公司财务董事,2007年9月至2008年6月任交银施罗德基金管理有限公司高级总经理顾问,2008年7月至2012年9月任施罗德投资管理(香港)有限公司首席营运官,2012年9月至今任柏瑞投资亚洲有限公司首席财务官。

王桂芳女士:监事,硕士,1996-2003年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理,2003-2006年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理,2006年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生: 监事, 硕士,2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务,2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员,2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理、上证红利ETF基金经理,2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月起兼任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起担任华泰柏瑞沪深300ETF及华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。

陈培先生:监事,硕士。2001-2004年,就职于富国基金管理有限公司,任基金会计等职。2004年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,现任基金事务部总监。

3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生:总经理,博士,曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会,2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王溯舸先生:副总经理,硕士,1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理,2001-2004年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士:督察长,硕士,1993-1999年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表,1999-2004年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生:副总经理,硕士,1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理,2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士:副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司(BGI)担任投资经理, 2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司,2013年8月起任华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金的基金经理,2013年9月起任公司副总经理。 本科与研究生毕业于清华大学,MBA毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

高山先生,副总经理,博士。2001.5-2013.7任职于全国社会保障基金理事会投资部,任处长;2013.7起加入华泰柏瑞基金管理有限公司。本科毕业于山东大学经济管理学院,硕士毕业于中国人民银行研究生部,博士毕业于财政部财政科学研究所研究生部。

4、本基金基金经理

郑青女士,9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,任债务研究员。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的基金经理。

历任本基金基金经理:

沈涛先生,2009年5月6日至2012年10月10日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

主席:总经理韩勇先生;

成员:副总经理王溯舸先生;副总经理田汉卿女士;副总经理高山先生;总经理助理董元星先生;投资部总监沈雪峰女士;投资部副总监吕慧建先生。

列席人员:督察长陈晖女士;投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人:田国立
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管业务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:王永民
客服电话:95566
传真:(010)66594942

(二)基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况

截至2014年9月30日,中国银行已托管293只证券投资基金,其中境内基金268只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,包括风险识别,风险评估,工作程序设计与制度建设,风险检视,工作程序与制度的执行,工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2013年,中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

1、直销机构:

华泰柏瑞基金管理有限公司
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
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人:齐亮
电话:(021)38784638
传真:(021)50103016
联系人:汪莹白
客服电话:400-888-0001,(021)38784638
公司网址:www.huatai-pb.com

2、代销机构

1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
传真:(010)66594853
客服电话:95566
公司网址:www.boc.cn

2)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市复兴门内大街55号
办公地址:北京市复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
传真:(010)66107914
客服电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

3)中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:蒋超良
传真:(010)85109219
客服电话:95599
公司网址:www.abchina.com

4)中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
联系人:陈春林
传真:(010)68858117
客服电话:95580
公司网址:www.psbc.com

5)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系人:曹榕
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
客服电话:95559
公司网址:www.bankcomm.com

6)招商银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195109
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

7)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:肖遂宁
联系人:张青
电话:(0755)82088888
传真:(0755)25841098
客服电话:95501
公司网址:www.sdb.com.cn

8)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
联系人:杨宁
电话:(010)65556612
传真:(010)65550828
客服电话:95558
公司网址:bank.ecitic.com

9)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
联系人:董云巍
客服电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

10)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:王曦
电话:010-66223584
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

11)浙商银行股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市庆春路288号
办公地址:浙江省杭州市庆春路288号
法定代表人:张达洋
联系人:毛真海/刘坚
电话:0571-87659546/87659234
传真:0571-87659188
客服电话:95527
公司网址:www.czbank.com

12)嘉兴银行股份有限公司
注册地址:嘉兴市建国南路409号
办公地址:嘉兴市建国南路409号
法定代表人:许洪明
联系人:陈兢
电话:0573-82082676
传真:0573-82099678
客服电话:0573-96528
公司网址:www.bojx.com

13)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道1600号32层
办公地址:上海浦东新区世纪大道1600号32层
法定代表人:宫龙云
联系人:戴莉丽
电话:(021)32229888
传真:(021)68728703
客服电话:(021)63340678
公司网站:www.ajzq.com

14)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
电话:(0755)82825551
传真:(0755)82558355
客服电话:400-800-1001
公司网址:www.essence.com.cn

15)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:王兆权
电话:(022)28451861
传真:(022)28451892
客服电话:400-651-5988
公司网址:www.bhzq.com

16)财富证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
法定代表人:蔡一兵
联系人:郭磊
电话:(0731)84403319
传真:(0731)84403439
客服电话:(0731)84403319
公司网址:www.cfzq.com

17)财通证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
联系人: 徐铁青
电话:(0571)87822359
传真:(0571)87818329
客服电话:96336(浙江),40086-96336(全国)
公司网址:www.ctsec.com

18)长城证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人:高峰
电话:(0755)83516094
传真:(0755)83515567
客服电话:(0755)33680000、400-6666-888
公司网址:www.cgws.com

19)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
电话:(027)65799999
传真:(027)85481900
客服电话:95579或4008-888-999
公司客服网址:www.95579.com

20)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市福山路500号26楼
办公地址:上海市福山路500号26楼
法定代表人:姚文平
联系人:徐可
电话:(021)68761616
传真:(021)68767981
客服电话:400-888-8128
公司网址:www.tebon.com.cn

21)第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
电话:(0755)25831754
传真:(0755)82485081
客服电话:400-888-1888
公司网址:www.firstcapital.com.cn

22)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼21-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:胡月茹
电话:(021)63325888
传真:(021)63327888
客服电话:95503
公司网址:www.dfzq.com.cn

23)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:刘化君
联系人:梁旭
电话:(0519)88157761
传真:(0519)88157761
客服电话: 400-888-8588
公司网址:www.longone.com.cn

24)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市工业园区星阳街5号
办公地址:江苏省苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:(0512)65581136
传真:(0512)65588021
客服电话:(0512)33396288
公司网址:www.dwjq.com.cn

25)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤漫川
电话:(010)66555316
传真:(010)66555246
客服电话:400-888-8993
公司网址:www.dxzq.net.cn

26)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:郭军瑞
电话:(0731)85832503
传真:(0731)85832214
客服电话:95571
公司网址:www.foundersc.com

27)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:周洁瑾
电话:(021)22169999
传真:(021)22169134
客服电话:95525
公司网址:www.ebscn.com

28)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:(020)87555888
传真:(020)87555305
客服电话:95575
公司网址:www.gf.com.cn

29)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20层
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20层
法定代表人:邱三发
联系人:林洁茹
电话:(020)88836999
传真:(020)88836654
客服电话:961303
公司网址:www.gzs.com.cn

30)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:(010)84183333
传真:(010)84183311-3389
客服电话:400-818-8118
公司网址:www.guodu.com

31)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
联系人:沈刚
电话:(0510)82831662
传真:(0510)82833217
客服电话:95570
公司网址:www.glsc.com.cn

32)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:万建华
联系人: 芮敏棋
电话:(021)38676666
传真:(021)38670666
客服电话:95521
公司网址:www.gtja.com

33)国信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:周杨
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133952
客服电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

34)海通证券股份有限公司
注册地址: 上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
电话:(021)23219000
传真:(021)23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址:www.htsec.com

35)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人: 庞介民
联系人:扬子莹
电话:(0471)4974437
客服电话:(0471)4961259
公司网址:www.cnht.com.cn

36)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:(010)88085858
传真:(010)88085195
客服电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com

37)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
联系人:汪明丽
电话:(021)68778075
传真:(021)68777723
客服电话:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com

38)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福建省福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
客服电话:96326(福建省外请加拨0591)
公司网址:www.hfzq.com.cn

39)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:(0931)4890208
传真:(0931)4890118
客服电话:(0931)4890100、4890619、4890618
公司网址:www.hlzqgs.com

40)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号华融大厦A座3层
法定代表人:宋德清
联系人:黄恒
电话:(010)58568235
传真:(010)58568062
客服电话:(010)58568118;或前往各营业网点咨询
公司网址:www.hrsec.com.cn

41)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:孔晓君
电话:(0755)82569143
传真:(0755)82492962
客服电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

42)华鑫证券有限责任公司
注册地址:上海市肇家浜路750号
办公地址:上海市肇家浜路750号
法定代表人:洪家新
联系人:程学军
电话:(021)64379456
传真:(021)64333051
客服电话: 021-32109999、029-68918888
公司网址:www.cfsc.com.cn

43)南京证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市大钟亭8号
办公地址:江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人:张华东
联系人:李铮
电话:(025)52310585
传真:(025)52310586
客服电话:400-828-5888
公司网址:www.njzq.com.cn

44)平安证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:广东省深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑舒丽
电话:(0755)22626391
传真:(0755)82400862
客服电话:95511*8
公司网址:stock.pingan.com

45)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:(0531)68889155
传真:(0531)68889752
客服电话:95538
公司网址:www.qlzq.com.cn

46)山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
电话:(0351)8686659
传真:(0351)8686619
客服电话:400-666-1618、(0351)95573
公司网址:www.i618.com.cn

47)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号华旭大厦
办公地址:上海市西藏中路336号华旭大厦
法定代表人:郁忠民
联系人:张瑾
电话:(021)53519888
传真:(021)53519888
客服电话:400-891-8918,(021)962518
公司网址:www.962518.com

48)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪贸易广场45层
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
联系人:黄莹
电话:(021)33388211
传真:(021)33388224
客服电话:95523或4008895523
公司网址:www.sywg.com

49)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
联系人:林爽
电话:(010)66045529
传真:(010)66045518
客服电话:(010)66045678
公司网址:www.txsec.com或www.jjm.com.cn

50)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:罗创斌
电话:(020)37865070
传真:(020)37865008
客服电话:400-888-8133
公司网址:www.wlzq.com.cn

51)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:(023)63786141
传真:(023)63810422
客服电话:400-809-6096
公司网址:www.swsc.com.cn

52)湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:林俊波
联系人:钟康莺
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com

53)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:(010)63081000
传真:(010)63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com

54)兴业证券股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼
法定代表人:兰荣
联系人:夏中苏
电话:(0591)38281963
客服电话:400-888-8123
公司网址:www.xyzq.com.cn

55)招商证券股份有限公司
注册地址: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
联系人:林生迎
电话:(0755)82960223
传真:(0755)82960141
客服电话:95565
公司网址:www.newone.com.cn

56)浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:李凌芳
电话:(021)64718888
传真:(0571)87901913
客服电话:(0571)967777
公司网址:www.stocke.com.cn

57)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人:赵大建
联系人:李微
电话:(010)59355941
传真:(010)66553791
客服电话:400-889-5618
公司网址:www.e5618.com

58)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:宋明
电话:(010)66568450
传真:(010)66568990
客服电话:400-888-8888
公司网址:www.chinastock.com.cn

59)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:王宜四
联系人:戴蕾
电话:(0791)86768681
传真:(0791)86770178
客服电话:400-886-6567
公司网址:www.avicsec.com

60)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元?
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层?
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:(0755)82023442
传真:(0755)82026539
客服电话:400-600-8008
公司网址:www.china-invs.cn

61)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:400-8888-108
传真:(010)65182261
客服电话:400-888-8108
公司网址:www.csc108.com

62)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层(266061)
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:(0532)85022326
传真:(0532)85022605
客服电话:95548
公司网址:www.citicssd.com

63)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:腾艳
电话:(010)60838888
传真:(010)60833739
客服电话:95558
公司网址:www.cs.ecitic.com

64)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
联系人:李珊
电话:(0571)85776114
传真:(0571)85783771
客服电话:(0571)96598
公司网址:www.bigsun.com.cn

65)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:李丹
电话:(021)68604866
传真:(021)50372474
客服电话:400-620-8888
公司网址:www.bocichina.com

66)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
联系人:程月艳、耿铭
电话:(0371)65585670
传真:(0371)65585665
客服电话:(0371)967218
公司网址:www.ccnew.com

67)宏信证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市锦江区人民南路2段18号川信大厦10楼
办公地址:四川省成都市锦江区人民南路2段18号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
联系人:郝俊杰
电话:028-86199278
传真:028-86199079
客服电话:4008366366
公司网址:www.hx818.com

68)上海长量基金销售投资顾问有限公司基金公司相关信息
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

69)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-58870011-6702
传真:021-68596916
客服电话:400-700-9665
公司网址:http://www.ehowbuy.com

70)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号二号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509988-7019
传真:021-64385308
客服电话:400-181-8188
公司网址:www.1234567.com.cn

71)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:(0755)82080798
传真:(0755)82080798
客服电话:400-678-8887
公司网址:www.jjmmw.com;www.zlfund.cn

72) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:李兆贺
电话:010-62020088
传真:010-62020355
客服电话:400-888-6661
公司网址:www.myfund.com

73)公司名称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人: 凌顺平
联系人:杨翼
电话:0571-88911818
传真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com

74)公司名称: 杭州数米基金销售有限公司
代销机构: 杭州数米基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
联系人:张裕
电话:021-60897840
传真:0571-26698533
客服电话:4000-766-123
公司网站: http://www.fund123.cn/

75)公司名称: 中期时代基金销售(北京)有限公司
代销机构:中期时代基金销售(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
电话:010-65807865
传真:010-65807864
客服电话:010-65807609
公司网站:www.cifcofund.com

76)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:于杨
电话:021-20835779
客服电话:400-920-0022
公司网址:licaike.hexun.com

77)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
法定代表人: 李招弟
联系人:刘媛
电话:(010)59393923-819
客服电话:400-808-0069
公司网址:www.wy-fund.com

78)中国国际期货有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
法定代表人:王兵
联系人: 赵森
电话:(010) 5953 9864
公司网址: www.cifco.net
客服电话:95162、400-8888-160

79)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟桦
联系人: 刘梦轩
电话:(010)-52858244
公司网址:www.yixinfund.com
客服电话:400 6099 200

80)上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层
法定代表人: 申健
联系人: 付江
电话:(021)20219988*31781
公司网址: www.gw.com.cn
客服电话:021-20219999

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:华泰柏瑞基金管理有限公司
住所:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
法定代表人:齐亮
办公地址:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层
电话:(021)38601777
传真:(021)50103016
联系人:陈培

(三)律师事务所和经办律师

名称:北京市金杜律师事务所
地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层
负责人:王玲
联系电话:021-24126000
传真:021-24126150
经办律师:靳庆军、黄晓黎
联系人:黄晓黎

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所: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
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:单峰
经办注册会计师:薛竞、单峰

四、基金的名称

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在有效保持基金资产安全和高流动性的前提下,追求超过业绩基准的稳健投资收益。

七、基金的投资范围

本基金投资于以下金融工具:1、现金;2、通知存款;3、1 年以内(含1 年)的银行定期存款、大额存单;4、短期融资券;5、剩余期限在397 天以内(含397 天)的债券;6、期限在1 年以内(含1 年)的债券回购;7、期限在1 年以内(含1 年)的中央银行票据;8、剩余期限在397 天以内(含397 天)的资产支持证券;9、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将采用主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资, 在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性, 在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得稳健的投资收益。

1、利率预期策略:本基金将首先采用利率预期策略(Interest-Rate Expectation Strategy),通过利率分析系统,综合研究国内外宏观经济趋势、财政及货币政策导向、短期资金的供求状况等因素从而对货币市场利率走势进行预测。根据对未来利率走势的科学预测最终形成投资组合的平均剩余期限,若预测未来利率将上升,则降低投资组合的平均剩余期限,反之,则增加投资组合的平均剩余期限。本基金的平均剩余期限将控制在120天之内。

2、估值中枢策略:运用不同品种的收益率曲线预测模型,对货币市场工具进行合理估值,确定价格中枢的变动趋势。综合考虑基金资产组合的流动性、收益率、风险等因素以及债券的估值原则,合理选择不同市场中有投资价值的券种,并根据投资环境的变化作相应调整。

3、类属配置策略:在保持组合资产相对稳定的条件下,本基金在实际操作中将主要依据各类短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境, 决定不同类属的配置比例;再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别品种的具体资产配置比例。

4、流动性管理策略:本基金将在动态测算基金投资者净赎回资金需求、季节性资金流动等因素的前提下,对基金资产进行合理配置,通过实时追踪基金资产的现金库存、资产变现能力等因素,合理配置和动态调整组合现金流,在保持基金财产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益,结合持续性投资的方法,将各类属资产的到期日进行均衡等量配置,以确保基金资产的整体变现能力。

九、业绩比较基准

当期银行活期存款税后收益率

基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下,可根据投资目标、投资方向和投资策略,确定变更业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,基金管理人应在调整前在至少一种指定媒体上公告,并在更新的招募说明书中列示。

十、风险收益特征

本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

十一、基金投资组合报告

投资组合报告截止日为2014年9月30日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	6,275,161,964.43	46.38
	其中:债券	6,275,161,964.43	46.38
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	972,802,379.20	7.19
	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	6,128,039,863.38	45.29
4	其他资产	153,689,963.83	1.14
5	合计	13,529,694,170.84	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	9.07
	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	1,265,655,727.16	10.35
	其中:买断式回购融资	–	–

注:1)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资产净值比例的简单平均值。2)在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%

3 期末基金组合剩余期限

3.1 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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天

3.2 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(%)
1	30天以内	10.35
	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	–
合计		10.35

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
	其中:政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	800,084,473.64	6.54

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	140212	14国开12	4,500,000	449,816,758.73	3.68
2	041458049	14中铝业CP003	4,400,000	439,933,800.88	3.60
3	041461048	14津城建CP002	3,000,000	299,721,106.25	2.45
4	011420005	14中铝SCP005	2,800,000	280,004,487.18	2.29
5	041457001	14中色CP001	2,000,000	200,584,825.13	1.64
6	041463015	14首钢CP001	2,000,000	200,232,088.79	1.64
7	041461029	14滨建投CP002	2,000,000	200,160,509.37	1.64
8	011415004	14中铝业SCP004	2,000,000	199,984,026.01	1.64
9	130211	13国开11	1,900,000	189,820,543.77	1.55
10	090205	09国开05	1,800,000	180,676,721.43	1.48

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	–
报告期内偏离度的最高值	0.1546%
报告期内偏离度的最低值	0.0161%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0791%

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

注: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

8.1 基金计价方法说明。

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额资产净值保持在人民币1.00 元。

8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于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的20%的情况。

8.3 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。

8.4 其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	153,814,658.56
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	-124,694.73
7	其他	–
8	合计	153,689,963.83

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

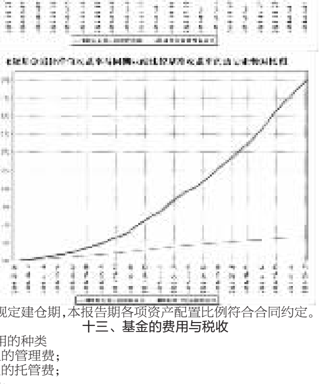
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为2014年9月30日。

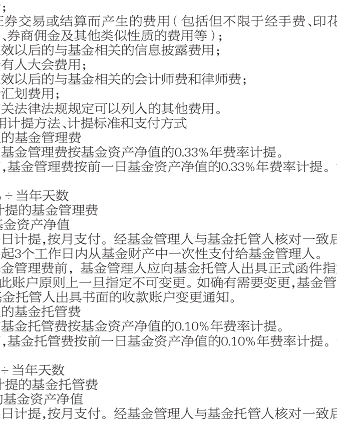
1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

	阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
A级	基金合同生效日至2009年年底	0.2630%	0.0005%	0.2400%	–	0.0230%	0.0005%
	2010年	0.9293%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.5643%	0.0011%
	2011年	2.3200%	0.0025%	0.4762%	0.0001%	1.8438%	0.0024%
	2012年	3.1068%	0.0029%	0.4260%	0.0002%	2.6808%	0.0027%
	2013年	4.1323%	0.0032%	0.3549%	0.0000%	3.7774%	0.0032%
	过去三个月	1.0578%	0.0024%	0.0894%	0.0000%	0.9684%	0.0024%
B级	基金合同生效日至2009年年底	0.4225%	0.0005%	0.2400%	–	0.1825%	0.0005%
	2010年	1.1701%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.8051%	0.0011%
	2011年	2.5603%	0.0025%	0.4762%	0.0001%	2.0841%	0.0024%
	2012年	3.3471%	0.0029%	0.4260%	0.0002%	2.9211%	0.0027%
	2013年	4.3717%	0.0032%	0.3549%	0.0000%	4.0168%	0.0032%
	过去三个月	1.1183%	0.0024%	0.0894%	0.0000%	1.0289%	0.0024%

注:本基金的收益分配是按月结转份额。

自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金未规定建仓期,本报告期内各项资产配置比例符合合同约定。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、销售服务费;

4、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等);

5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费;

8、基金的资金汇划费用;

9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.33%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.33%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

在首期支付基金管理费前, 基金管理人应向基金托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。此账户原则上一旦指定不可变更。如确有需要变更,基金管理人应提前10个工作日向基金托管人出具书面的收款账户变更通知。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、基金的销售服务费

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、服务等活动。本基金A级基金份额的销售服务年费率为0.25%,B级基金份额的年费率为0.01%。

各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×R÷当年天数

H为每级基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日该级基金份额的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务费率

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率, 但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日前的3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

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,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人相应支付给基金销售机构。

在首期支付销售服务费前, 基金管理人应向托管人出具正式函件指定销售服务费的收款账户。此账户原则上一旦指定不可变更。如确有需要变更,基金管理人应提前10个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。

4、本条第(一)款第4至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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不列入基金费用。

(四)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费, 无须召开基金份额持有人大会; 调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人和基金托管人协商一致可以在基金合同规定的范围内调整销售服务费, 无须召开基金份额持有人大会。基金管理人应最迟于新的费率实施日前3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(五)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、“三、基金管理人”部分,对基金管理人概况的总经理及其他高级管理人员、投资决策委员会成员相关信息作了更新。

2、“四、基金托管人”部分,根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。

3、“五、相关服务机构”部分,对代销机构相关内容进行了更新。

4、“十、基金的投资”部分,对基金投资组合报告作了更新。

5、“十一、基金的业绩”部分,对基金投资业绩作了更新。

6、“二十三、其他应披露事项”部分,根据前次招募说明书(更新)公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一四年十二月十八日