

交银施罗德天鑫宝货币市场基金 更新 招募说明书摘要

2017年第2号)

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

二〇一七年十二月

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日起的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】交银施罗德天鑫宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经2016年9月22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[2016]2172号文准予募集注册,本基金合同于2016年12月7日正式生效。

基金管理人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注册,但中国证监会不对本基金募集的注册,并不表明对本基金的优劣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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断。

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财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,也不保证基金份额持有人能全数收回其原本投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据持有的份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资人本基金可能遇到的风险包括:因受到经济因素、政治因素、投资政策和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险;基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险;由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险;交易者对违约风险、投资货币市场基金特有的其他风险等。本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于货币市场基金、混合型基金和债券型基金。

本基金投资于货币市场,面临货币市场利率波动的风险,基金每日的收益将根据市场情况而波动,在极端情况下可能为负值。由于货币市场基金的特殊要求,为满足投资者的赎回需要,基金管理人必须保持一定的现金比例以应对赎回的需求,在管理现金头寸时,有可能存在现金不足的风险或现金过多而带来的机会成本风险。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到0.5%时,基金管理人将暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。故投资者可能面临暂停申购的风险。当负偏离度绝对值连续两个交易日超0.5%时,基金管理人应采用公允价值估值方法对持有资产组合的账面价值进行调整,或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。故投资者可能面临上述估值调整或暂停赎回及基金合同提前终止的风险。

在满足相关流动性风险管理要求的前提下,当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及在5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低于5%且偏离度为负时,当日单个基金份额持有人可能面临被征收1%的强制赎回费的费用。

兴业银行股份有限公司总行资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、养老金管理中心等处室,共有员工100余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

【四】基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号,截止2017年6月30日,兴业银行已托管开放式基金183只,托管基金规模现为74164亿元。

【五】基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

跨品种套利策略:根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益

整体持续的变脸能力。

2、其他金融工具投资策略

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

3、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

4、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

5、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

6、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

7、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

8、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

9、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

10、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

11、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

12、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

13、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

14、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

15、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

16、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

17、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

18、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

19、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

20、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

21、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

22、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

23、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

24、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

25、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的无风险套利机会。

26、内部控制制度

本基金将密切关注货币承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品

比例遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,动态调整基金资产配置比例。如,当交易所市场回购利率高于银行间市

回购利率时,可增加交易所市场回购的配置比例;另外,还包括一级市场发行定价

和二级市场流通成交之间的