招商保证金快线货币市场基金上市交易公告书

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2014年10月20日
公告时间:2014年10月15日

一、重要声明与提示

招商保证金快线货币市场基金(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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书(以下简称“本公告书”)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、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。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅招商基金管理有限公司网站(www.cmfchina.com)上公告的《招商保证金快线货币市场基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:招商保证金快线货币市场基金
2、基金类型:货币ETF
3、基金运作方式:交易型、开放式
4、本基金A类、B类两类基金份额分别设置代码,并分别公布基金份额的每百份基金已实现收益和七日年化收益率,但投资者进行基金份额的申购、赎回、买卖时,两类基金份额共用基金申购赎回和交易代码(159003)。
5、基金存续期限:不定期
6、基金的申购与赎回:基金投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日,开放时间为上午9:15-11:30 和下午1:00-3:00。
7、基金份额的自动升降级:(1)若A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过30,000份时,基金管理人自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额。(2)若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于30,000份时,基金管理人自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额。
9、基金份额总额:截至2014年10月13日,本基金的基金份额总额为1,607,403份。
10、基金份额参考净值:截至2014年10月13日,基金份额净值为100.00元。
11、本次上市交易的基金份额场内简称及其基金代码:招商快线(基金代码:159003)。
12、本次上市交易的基金份额总额:1,607,403份(截至2014年10月13日)。
13、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
14、上市交易日期:2014年10月20日
15、基金管理人:招商基金管理有限公司
16、基金托管人:平安银行股份有限公司
17、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)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证监许可【2013】65号
2、基金合同生效日:2013年5月17日
3、基金运作方式:开放式
4、基金合同期限:不定期
5、发售日期:2013年5月13日至2013年5月13日
6、发售价格:1.00元人民币
7、发售方式:网上现金认购、网下现金认购
8、发售机构:
(1)网下现金发售机构:招商基金管理有限公司
(2)网上现金发售代理机构:
国海证券、西南证券、中银万国证券、国信证券、恒泰证券、广州证券、财富证券、方正证券、华安证券、中国中投证券、华泰证券、东方证券、兴业证券、浙商证券、东吴证券、光大证券、华宝证券、东海证券、国泰君安证券、齐鲁证券、中国银河证券、中信证券、中信万通证券、中信证券(浙江)、宏源证券、国都证券、山西证券、渤海证券、中信建投证券、华龙证券、东兴证券、海通证券。(上述排名不分先后)
9、验资机构名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
10、募集资金总额及入账情况
本基金于2013年5月13日起公开募集,基金募集工作已于2013年5月13日顺利结束。经毕马威华振会计师事务所验资,本次募集的有效认购资金人民币3,387,718,000.00元,基金注册登记机构记录的有效认购资金利息转份额人民币94,874.00,共计人民币3,387,812,874.00元。上述资金及利息折合3,387,812,874.00份基金份额。有效认购资金人民币3,387,718,000.00元已于2013年5月17日划入本基金在基金托管人平安银行股份有限公司开立的基金托管专户。此外,经中国证券登记结算有限责任公司确认,上述有效认购资金利息转份额中对应的应收利息人民币94,874.00元将于招商保证金快线货币市场基金成立之后的下一银行季度结息日(即2013年6月20日)后结转入相关账户。本次募集有效认购总户数为7,256户。
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》、《证券投资基金运作管理办法》以及《招商保证金快线货币市场基金基金合同》、《招商保证金快线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2013年5月17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。
12、基金合同生效日的基金份额总额:3,387,812,874.00份
13、本基金管理人及基金从业人员持有基金份额的情况:

份额级别		基金份额
募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	-
	占基金总份额比例	-
	其他需要说明的事项	-
募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	-
	占基金总份额比例	-

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。
(二)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:深圳证券交易所深证上[2014]367号
2、上市交易日期:2014年10月20日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金场内简称
份额简称:招商快线
5、交易代码:159003
6、本次上市交易份额:1,607,403份
7、基金资产净值的披露:在本基金上市交易前或者开始办理申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日基金份额净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数
截至2014年10月13日,招商快线持有人户数为1190户,平均每户持有的基金份额为1,350.76份。
(二)持有人结构
截至2014年10月13日,机构投资者持有的本次上市交易的基金份额为745,906份,占本次上市交易基金份额比例为46.40%;个人投资者持有的本次上市交易的招商快线基金份额为861,497份,占本次招商快线上市交易基金份额比例为53.60%。
(三)前十名场内基金份额持有人情况(截至2014年10月13日)

序号	持有人名称(全称)	基金份额	占基金份额的比例(%)
1	美盛投资(欧洲)有限公司—LEGG MASON PERMAL CHINA ALPHA FUND	300,000.00	18.66%
2	招商基金管理有限公司	270,000.00	16.80%
3	徐立勋	255,120.00	15.87%
4	安信农业保险股份有限公司	167,795.00	10.44%
5	姜凤伶	86,115.00	5.36%
6	周菊芬	50,661.00	3.15%
7	任萍	30,000.00	1.87%
8	郝守域	30,000.00	1.87%
9	郝迪曦	30,000.00	1.87%
10	李智勇	25,010.00	1.56%
合计		1,244,701.00	77.44%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳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、公司概况
名称:招商基金管理有限公司
法定代表人:张光华
总经理:许小松
设立日期:2002年12月27日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
注册资本:人民币21亿元
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2002]100号
工商登记注册的法人营业执照文号:100000400009761
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。
存续期间:持续经营
电话:(0755)83196351
传真:(0755)83076974
联系人:曾倩
2、股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	55.0%
招商证券股份有限公司	45.0%

3、内部组织结构及职能
公司具体经营管理由总经理负责,公司根据经营运作需要设置董事会办公室、投资管理一部、固定收益投资部、交易部、研究部、投资管理二部、投资管理三部、投资管理四部、全球量化投资部、渠道管理部、市场部、互联网金融部、产品研发部、国际业务部、机构理财部、信息技术部、基金核算部、基金事务部、法律合规部、风险管理部、总经理办公室、人力资源部、财务部等22个职能部门,并设有北京分公司、上海分公司、成都分公司等分支机构。
各部门主要职能如下:
董事会办公室:负责公司董事会相关工作。
投资管理一部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
固定收益投资部:负责固定收益产品的投资。
交易部:负责公司所有产品的交易管理工作。
研究部:负责宏观、策略、行业和公司研究。
投资管理二部:负责专户产品的投资。
投资管理三部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
投资管理四部:根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。
全球量化投资部:负责量化产品和指数产品的投资。
渠道管理部:负责基金的渠道销售工作。
市场部:负责营销策划、客户服务、市场推广等工作。
互联网金融部:负责互联网金融平台的搭建、对接与产品的销售等工作。
产品研发部:负责产品研发、申报等工作。
国际业务部:负责海外基金产品的投资研究。
机构理财部:负责机构销售业务。
信息技术部:负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。
基金核算部:负责公司基金的会计核算、估值。
基金事务部:负责公司基金的注册登记、资金清算。
法律合规部:负责对公司和基金运作合规性监察、稽核审计、法务支持及日常信息披露事宜。
风险管理部:负责对公司日常营运进行风险管理及风险检查;负责投资业绩评价。
总经理办公室:负责文档、印鉴管理,公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。
人力资源部:负责公司人力资源管理工作。
财务部:负责公司财务管理、会计核算等相关工作。
各分公司:负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。
4、人员情况
截至2014年9月30日,公司共有员工262人,其中228人通过中国证券业协会组织的证券从业资格考试,具有基金从业资格。
5、信息披露负责人及咨询电话:
欧志明,(0755)83196401。
6、基金管理业务情况
本基金管理公司目前管理41只基金,其中封闭式基金1只;招商信用添利债券型证券投资基金;开放式基金40只。
7、本基金基金经理简介
胡慧颖,女,中国国籍,经济学学士。2006 年加入招商基金管理有限公司,先后在交易部、专户资产投资部、固定收益部从事固定收益产品的交易、研究、投资相关工作。现任招商现金增值开放式证券投资基金基金经理(管理时间:2010年8月19日至今)、招商产业债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年3月21日至今)、招商信用增强债券型证券投资基金基金经理(管理时间:2012年7月20日至今)、招商保证金快线货币市场基金基金经理(管理时间:2013年5月17日至今)。
(二)基金托管人
1、基金托管人概况
名称:平安银行股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:孙建一
成立日期:1987年12月22日
组织形式:股份有限公司
注册资本:5,123,350,416元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2008]1037号
联系人:李玉彬
联系电话:(0755) 2216 8677
2、主要人员情况
平安银行总行设资产托管事业部,下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT系统支持处、督察合规处7个处室,现有员工42人。
(三)基金验资机构
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人:姚建华
电话:(0755)2547 1000
传真:(0755)8266 8930
经办注册会计师:王国蓓、邱春娇
联系人:蔡正轩
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
截至公告前两个工作日即2014年10月13日,本基金的资产负债表如下:

资产负债表

会计主体:招商保证金快线货币市场基金
报告截止日:2014年10月13日 单位:人民币元

资 产	本报告期末 2014年10月13日
资 产:	
银行存款	20,508,894.62
结算备付金	-
存出保证金	103,084.04
交易性金融资产	52,950,644.86
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	52,950,644.86
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	144,960,937.44
应收证券清算款	-
应收利息	1,139,044.20
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	219,662,605.16
负债和所有者权益	**本报告期末 2014年10月13日**
负 债:	
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	32,842.77
应付赎回款	-
应付管理人报酬	13,029.89
应付托管费	5,211.98
应付销售服务费	5,655.31
应付交易费用	11,931.91
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	430,603.22
递延所得税负债	-
其他负债	330,930.08
负债合计	830,205.16
所有者权益:	
实收基金	218,832,400.00
未分配利润	-
所有者权益合计	218,832,400.00
负债和所有者权益总计	219,662,605.16

八、基金投资组合
截至公告前两个工作日即2014年10月13日(以下称“报告期末”),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	52,950,644.86	24.11
	其中:债券	52,950,644.86	24.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	144,960,937.44	65.99
	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	20,508,894.62	9.34
4	其他资产	1,242,128.24	0.57
5	合计	219,662,605.16	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	2.74
	其中:买断式回购融资	-

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	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

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的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2013年9月25日	21.00	赎回导致波动异常	已于2个交易日内完成调整
2	2013年9月26日	20.65	赎回导致波动异常	已于1个交易日内完成调整
3	2013年11月21日	20.07	赎回导致波动异常	已于1个交易日内完成调整

(三)基金投资组合平均剩余期限
1. 投资组合平均剩余期限本期末情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	35
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	146
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2013年11月26日	137	赎回导致被动超标	已于4个交易日内完成调整
2	2013年11月27日	144	赎回导致被动超标	已于3个交易日内完成调整
3	2013年11月28日	146	赎回导致被动超标	已于2个交易日内完成调整
4	2013年11月29日	129	赎回导致被动超标	已于1个交易日内完成调整

注:本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期内,本基金发生过4次投资组合的平均剩余期限超过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	71.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	13.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	6.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	4.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.86	-

(四)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	19,911,548.43	9.10
	其中:政策性金融债	19,911,548.43	9.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	33,039,096.43	15.10
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	52,950,644.86	24.20
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	011420006	14中铝SCP006	100,000	10,012,059.87	4.58
2	011499019	14阳泉SCP001	100,000	10,000,423.59	4.57
3	140363	14进出63	100,000	9,903,520.27	4.53
4	011474002	14陕煤化SCP002	80,000	8,026,281.35	3.67
5	011415004	14中铝业SCP004	50,000	5,000,331.62	2.29
6	140204	14国开04	50,000	5,010,665.87	2.29
7	090220	09国开20	50,000	4,997,362.29	2.28

(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	9
报告期内偏离度的最高值	0.1828%
报告期内偏离度的最低值	-0.3180%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0615%

(七)报告期末按公允价值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
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. 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。
2. 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。
3. 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
4. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	103,084.04
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,139,044.20
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,242,128.24

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:
1、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。
2、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。
3、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:
1、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专职人员负责基金财产托管事宜。
2、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。
3、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。
4、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、备查文件目录
投资者如果需了解更详细的信息,可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件:
1、 中国证监会批准招商保证金快线货币市场基金募集的文件
2、《招商保证金快线货币市场基金基金合同》
3、《招商保证金快线货币市场基金托管协议》
4、《招商保证金快线货币市场基金代销协议》
5、《律师事务所法律意见书》
6、 招商基金管理有限公司业务资格批件、营业执照和公司章程
7、 平安银行股份有限公司业务资格批件和营业执照

招商基金管理有限公司
2014年10月15日

附件:基金合同摘要
(一)基金合同当事人及其权利义务
1、基金管理人的权利
(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规定或中国证监会批准的其他费用;
(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注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《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与赎回申请;
(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;
(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、转换的业务规则,决定和调整除调高管理费率、托管费率和销售服务费率之外的基金相关费率结构和收费方式;
(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
2、基金管理人的义务
(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、赎回和注册登记事宜;
(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、每百份(份额折算前为每万份)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、足额支付赎回对价;
(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,基金管理人承担全部募集费用,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。
3、基金托管人的权利
(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)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)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
4、基金托管人的义务
(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,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、每百份(份额折算前为每万份)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注册;
(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》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定;
(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。
5、基金份额持有人的权利
(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;
(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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
6、基金份额持有人的义务
(1)认真阅读并遵守《基金合同》;
(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)缴纳基金认购、申购、赎回对价及法律法规和《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)提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息,以及不时的更新和补充,并保证其真实性;
(10)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
1、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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
2、当出现或需要决定下列事由之一的,应召开基金份额持有人大会:
(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)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和销售服务费(法律法规要求提高该等报酬标准和销售服务费的除外);
(6)变更基金类型;
(7)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
(8)变更基金份额持有人大会程序;
(9)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
(10)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;
(11)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
(12)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。
3、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)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;
(3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的基金份额类别设置、调整申购费率、调低赎回费率和销售服务费率;
(4)在未来系统条件允许的情况下,安排本基金的上市交易事宜;
(5)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
(6)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;
(7)经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;
(8)经中国证监会允许,基金管理人、证券交易所、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、交易、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则;
(9)在不违反法律法规的情况下,调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成及日申购、赎回上限;
(10)在不违反法律法规的情况下,调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率;
(11)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以外的其他情形。
4、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;
(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;
(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