融通易支付货币市场证券投资基金 E 类基金份额
上市交易公告书

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2016 年 7 月 4 日

公告日期：2016 年 6 月 29 日

目 录

一、重要声明与提示 1
二、基金概览 1
三、基金的募集与上市交易 2
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况 4
五、基金主要当事人简介 5
六、基金合同摘要 8
七、基金财务状况 8
八、基金投资组合 10
九、重大事件揭示 13
十、基金管理人承诺 13
十一、基金托管人承诺 14
十二、基金上市推荐人意见 14
十三、备查文件目录 14
附件：基金合同摘要 16

一、重要声明与提示

《融通易支付货币市场证券投资基金 E 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〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，融通易支付货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）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。

本基金托管人中国民生银行股份有限公司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 E 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 2016 年 6 月 15 日刊登在《上海证券报》及融通基金管理有限公司网站（www.rtfund.com）上的《关于融通易支付货币市场证券投资基金增设场内基金份额、调整收益分配原则并修订基金合同部分条款的公告》，或登录融通基金管理有限公司网站（www.rtfund.com）查阅《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》。

二、基金概览

1、基金名称：融通易支付货币市场证券投资基金

2、本基金 E 类基金份额二级市场交易简称：融通货币

3、本基金 E 类基金份额二级市场交易代码：511910

4、本基金 E 类基金份额申购、赎回简称：融通货币

5、本基金 E 类基金份额申购、赎回代码：511911

6、2016 年 6 月 27 日本基金 E 类基金份额总额：4,885,419.00 份

7、2016 年 6 月 27 日本基金 E 类基金份额净值：100.00 元

8、本次上市交易份额：本基金 E 类基金份额总额：4,885,419.00 份（截至 2016 年 6 月 27 日）

9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

10、上市交易日期：2016 年 7 月 4 日

11、基金管理人：融通基金管理有限公司

12、基金托管人：中国民生银行股份有限公司

13、上市推荐人：无

14、目前，本基金 E 类基金份额的申购、赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）如下：

第一创业证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

基金管理人可根据实际情况变更申购、赎回代办券商并予以公告。

三、基金的募集与上市交易

（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：2005 年 12 月 15 日中国证监会证监基金字［2005］195 号文

2、基金合同生效日：2006 年 1 月 19 日

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金合同期限：不定期

5、发售日期：2005 年 12 月 28 日至 2006 年 1 月 16 日

6、发售价格：人民币 1.00 元

7、发售方式：场外认购

8、发售机构：

（1）直销机构

融通基金管理有限公司

（2）代销机构

中国民生银行、联合证券（更名为华泰联合证券）、银河证券、国泰君安证券、海通证券、光大证券、广发证券、国信证券、东北证券、南京证券、长城证券、招商证券、平安证券、东吴证券、东方证券、华泰证券、华安证券、宏源证券（与申银万国证券合并为申万宏源证券）、中信建投证券、第一创业证券、金元证券、中银国际证券和国盛证券等。

9、验资机构名称：安永华明会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况

募集期限届满，经安永华明会计师事务所验资，本基金有效认购户数为 4,277 户，本次发售净销售额为 2,823,042,601.54 元人民币。该资金已于 2006 年 1 月 18 日全额划入本基金在托管人中国民生银行股份有限公司开立的基金托管专户。依照《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》的规定，认购资金的银行利息共计 176,773.21 元，其中 175,572.79 元折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有，所余 1,200.42 元的计算尾差作为基金财产归基金所有。按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，发售募集期募集的基金份额及利息转份额共计 2,823,218,174.33 份基金份额。本次募集期间所发生的与本基金有关的信息披露费、律师费和会计师费等费用由本基金管理人承担，不另从基金财产支付。

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》和《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》、《融通易支付货币市场证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，融通基金管理有限公司已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2006 年 1 月 19 日获中国证监会基金部函［2006］11 号文确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（二）本基金 E 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：上海证券交易所自律监管决定书[2016]161 号文

2、上市交易日期：2016 年 7 月 4 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、二级市场交易简称：融通货币

5、二级市场交易代码：511910

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 E 类基金份额的二级市场交易。

6、申购、赎回简称：融通货币

7、申购、赎回代码：511911

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理 E 类基金份额申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金 E 类基金份额的申购和赎回业务。

目前，本基金的一级交易商包括：第一创业证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

基金管理人可根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 E 类基金份额 4,885,419.00 份（截至 2016 年 6 月 27 日）

9、未上市交易份额的流通规定：本基金包括场内份额和场外份额，本次上市的基金份额全部为场内份额，即 E 类基金份额。本基金 E 类基金份额上市交易后，所有的 E 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 类基金份额、B 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

（一）持有人户数

截至 2016 年 6 月 27 日，本基金 E 类基金份额持有人户数为 660 户，平均每户持有的基金份额为 7,402.15 份。

（二）基金份额持有人结构

截至 2016 年 6 月 27 日，本基金 E 类基金份额投资者持有基金份额 4,885,419.00 份，其中机构投资者持有的 E 类基金份额为 1,438,000.00 份，占 E 类基金份额总额的 29.43%；个人投资者持有的 E 类基金份额为 3,447,419.00 份，占 E 类基金份额总额的 70.57%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2016 年 6 月 27 日，本基金 E 类基金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 E 类总份额比例(%)
1	河南黄河实业集团股份有限公司	500,000.00	10.23%
2	新时代信托股份有限公司－润禾 26 号证券投资集合资金信托计划	400,000.00	8.19%
3	文登市森鹿制革有限公司	200,000.00	4.09%
4	深圳中电投资股份有限公司	140,000.00	2.87%
5	葛小莲	120,000.00	2.46%
6	马茂华	100,000.00	2.05%
7	上海九茂资产管理有限公司－九茂广运 1 号基金	100,000.00	2.05%
8	苑秀莲	100,000.00	2.05%
9	顾张桃	100,000.00	2.05%
10	李祥瑞	98,000.00	2.01%
	合计	1,858,000.00	38.03%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：融通基金管理有限公司

2、法定代表人：高峰

3、总经理：孟朝霞

4、注册资本：125,000,000 元人民币

5、注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

6、设立批准文号：中国证监会证监基字[2001]8 号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：9144030072857172XH

8、经营范围：发起设立基金；基金管理业务（具体经营业务按证监会颁发的经营许可证办理）

9、成立日期：2001 年 5 月 22 日

10、股东及其出资比例：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co.,Ltd.）40%。

10、内部组织结构及职能：

公司设立了投资决策委员会和风险管理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。风险管理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。

公司目前下设权益投资部、量化投资部、研究部、交易部、机构理财部、固定收益部、国际业务部、风险管理部、市场拓展部、北方营销中心、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心、西部营销中心、电子商务部、财务管理部、信息技术部、产品开发部、监察稽核部、登记清算部、综合管理部。

权益投资部、量化投资部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。机构理财部主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。固定收益部负责公司受托资产固定收益证券的研究和投资工作。国际业务部负责海外市场研究、投资。风险管理部负责对公司受托资产的投资运作进行全面的风险管理。市场拓展部、北方营销中心、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心及西部营销中心负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。电子商务部负责电子商务直销平台的搭建及维护，电子商务渠道的开发等。财务管理部财务制度制定、实施和运转。信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发。产品开发部负责境内外理财产品的跟踪研究以及新产品的创

新、开发。监察稽核部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。登记清算部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。综合管理部负责公司财务管理、企业文化建设、文字档案、相关后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

11、人员情况：

截至 2016 年 5 月 31 日，本公司共有 210 名员工，其中博士学位 8 人、硕士学位 115 人和学士学位 75 人。

12、信息披露负责人：涂卫东

咨询电话：0755-26948666

13、本基金基金经理

王涛先生，南开大学经济学硕士，13 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员、招商银行总行金融市场部交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司，任债券研究员。2015 年 1 月 6 日起至今任“融通易支付货币市场证券投资基金”、“融通汇财宝货币市场基金（2016 年 1 月 18 日由原融通七天理财债券型证券投资基金转型而来）”基金经理，2015 年 1 月 21 日起至今任“融通通源短融债券型证券投资基金”基金经理，2016 年 4 月 1 日起至今任“融通增利债券型证券投资基金”基金经理。

张一格先生，中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士，美国特许金融分析师（CFA）。9 年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益部总经理。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰信用债券型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月加入融通基金管理有限公司，2015 年 11 月 17 日起至今任“融通易支付货币市场证券投资基金”基金经理，2016 年 3 月 15 日起至今任“融通通盈保本混合型证券投资基金”基金经理，2016 年 4 月 28 日起至今任“融通增裕债券型证券投资基金”基金经理，2016 年 5 月 13 日起至今任“融通增祥债券型证券投资基金”基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：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：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字［2004］101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行于 1996 年 1 月 12 日在北京正式成立，是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日，中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日，中国民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。 2009 年 11 月 26 日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，

大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 63 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2016 年 3 月 31 日，中国民生银行已托管 86 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 1960.97 亿元。中国民生银行于 2007 年推出“托付民生•安享财富”托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”和“金牌创新力托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

（三）上市推荐人

无。

（四）验资机构

名称：安永华明会计师事务所

注册地址：北京朝阳区北大街 6 号北海万泰大厦 802—807

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层

法定发表人：葛明

经办注册会计师：葛明、金馨

电话：010-65246688

传真：010-85188298

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，不得从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金募集结束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 2016 年 6 月 27 日的资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为元）

日期：2016 年 6 月 27 日

资　　产	期　末　余　额	年　初　余　额
资　产 ：		
银行存款	18,210,301,988.45	25,076,143,945.29
结算备付金	320,999,904.68	-
存出保证金	16,263.61	-
交易性金融资产	16,091,169,422.01	14,801,664,728.55
其中：股票投资	-	-
债券投资	16,091,169,422.01	14,801,664,728.55
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	40,000,150.00	3,436,087,934.12
应收证券清算款	278,152,541.02	-
应收利息	251,404,596.71	177,503,618.25
应收股利	-	-
应收申购款	2,619,231.04	802,013,426.04
其他资产	-	-
资产合计:	35,194,664,097.52	44,293,413,652.25
负债和所有者权益	期　末　余　额	年　初　余　额
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	2,247,179,027.28	1,001,948,800.00
应付证券清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	8,835,094.97	5,787,463.63
应付托管费	2,677,301.54	1,753,776.83
应付销售服务费	334,528.07	263,796.40
应付交易费用	188,349.48	264,481.83

应付税费	124,200.00	124,200.00
应付利息	480,135.62	134,988.36
应付利润	4,007,570.22	30,696,574.30
其他负债	130,970.94	99,000.00
负债合计	2,263,957,178.12	1,041,073,081.35
所有者权益：		
实收基金	32,930,706,919.40	43,252,340,570.90
未分配利润		
所有者权益合计	32,930,706,919.40	43,252,340,570.90
负债与持有人权益总计：	35,194,664,097.52	44,293,413,652.25

八、基金投资组合

截至到 2016 年 6 月 27 日，本基金的投资组合如下（有关财务数据起始日为 2016 年 4 月 1 日，截止日为 2016 年 6 月 27 日，本公告书中的财务数据未经审计）：

（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	16,091,169,422.01	45.72
	其中：债券	16,091,169,422.01	45.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,000,150.00	0.11
	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	18,531,301,893.13	52.65
4	其他资产	532,192,632.38	1.51
5	合计	35,194,664,097.52	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	10.80	
	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	2,247,179,027.28	6.82
	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。

（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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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。

（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	23.43	1.30
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.42	-
2	30 天(含)-60 天	26.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.15	-
3	60 天(含)-90 天	18.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	16.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天（含）	20.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.10	1.30

（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	2,449,360,048.44	7.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,696,273,576.77	8.19
	其中：政策性金融债	2,696,273,576.77	8.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,927,105,151.02	21.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,018,430,645.78	12.20
8	其他	-	-

	合计	16,091,169,422.01	48.86%

（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	160209	16 国开 09	10,300,000	1,028,028,121.85	3.12%
2	019533	16 国债 05	6,600,000	660,269,732.05	2.01%
3	011606002	16 电网 SCP002	6,300,000	629,776,389.24	1.91%
4	140208	14 国开 08	4,700,000	479,567,704.38	1.46%
5	019539	16 国债 11	3,879,560	387,823,215.08	1.18%
6	019529	16 国债 01	3,400,000	340,235,695.92	1.03%
7	160304	16 进出 04	3,000,000	299,618,301.36	0.91%
8	111692592	16 广州农村商业银行 CD052	3,000,000	299,493,120.70	0.91%
9	111613056	16 浙商 CD056	3,000,000	298,737,918.05	0.91%
10	111612071	16 北京银行 CD071	3,000,000	298,681,624.01	0.91%

（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	0.1104%
报告期内偏离度的最低值	0.0475%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0643%

（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）本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

（2）本报告期内本基金没有出现持有剩余期限小于 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 20%的情况。

（3）本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

（4）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,263.61
2	应收证券清算款	278,152,541.02
3	应收利息	251,404,596.71
4	应收申购款	2,619,231.04
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	532,192,632.38

九、重大事件揭示

根据《关于融通易支付货币市场证券投资基金增设场内基金份额、调整收益分配原则并修订基金合同部分条款的公告》，本基金管理人于 2016 年 6 月 15 日对融通易支付货币市场证券投资基金增设场内基金份额（即 E 类基金份额），并修改基金收益分配原则，同时对基金合同进行相应修订。修订后的基金合同自 2016 年 6 月 15 日起生效，自 2016 年 6 月 20 日起接受投资者对 E 类基金份额的申购、赎回申请。

本基金 E 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。

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、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《基金法》及相关法律法规、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》及相关法律法规、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》及相关法律法规、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，并在限期内，随时对通知事项进行复查，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基金托管人的办公场所，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）中国证监会核准融通易支付货币市场证券投资基金募集的文件；

（二）《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》；

（三）《融通易支付货币市场证券投资基金更新的招募说明书》；

（四）《融通易支付货币市场证券投资基金托管协议》；

（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。

融通基金管理有限公司

2016 年 6 月 29 日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

1、基金份额持有人的权利

（1）按基金合同的约定分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）按基金合同的约定转让或申请赎回其持有的基金份额，并在规定的时间内取得有效赎回的款项；

（4）依照法律法规、基金合同及其他有关规定，要求召开基金份额持有人大会；

（5）按基金合同的约定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，就审议事项行使表决权；

（6）按基金合同的约定查阅或复制公开披露的基金信息资料；

（7）按基金合同的约定监督基金管理人的投资运作；

（8）要求基金管理人或基金托管人及时行使法律法规、基金合同所规定的义务；

（9）对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构、注册登记机构损害其合法权益的行为提起诉讼并要求予以赔偿；

（10）法律法规、基金合同规定的其它权利。

2、基金份额持有人的义务

（1）遵守有关法律法规、基金合同的规定；

（2）缴纳基金认购、申购、赎回等事宜涉及的款项及规定的费用；

（3）在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；

（4）不从事任何有损本基金及本基金其他当事人合法权益的活动；

（5）返还持有基金过程中获得的不当得利；

（6）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（7）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

（1）依法申请并募集基金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规及基金合同的规定运用基金财产；

（3）根据法律法规、基金合同及其他有关规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、收益分配、非交易过户、冻结等方面的业务规则；

（4）根据法律法规、基金合同及其他有关规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，从基金财产中计提销售服务费及其它事先经证监会批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；

（5）根据法律法规和基金合同销售基金份额；

（6）依据法律法规、基金合同及其他有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同约定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7）根据基金合同的规定选择、更换基金销售代理人并有权依照代理销售协议对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查；

（8）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册与过户登记业务，并按照基金合同约定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

（10）在法律法规允许的前提下，为基金进行融资；

（11）依据法律法规、基金合同及其他有关规定，决定基金收益的分配方案；

（12）按照法律法规，代表基金行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）依据法律法规、基金合同及其他有关规定，提议召开基金份额持有人大会；

(14)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者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（16）法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）自基金合同生效之日起，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（3）对所管理的不同基金财产分别设账、进行基金会计核算，编制财务会计报告及基金报告；

（4）充分考虑本基金的特点，并配备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）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回或委托其他机构代理该项业务；

（6）设置相应的部门并配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册与过户登记工作或委托其它机构代理该项业务；

（7）建立健全内部风险控制、监察稽核、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；

（8）除依据《基金法》等相关法律法规、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及基金份额持有人以外的任何第三方谋取利益；

（9）除依据法律法规和基金合同的规定外，不得委托第三人管理、运作基金财产；

（10）依法接受基金托管人的监督；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

（12）按有关规定计算并公告基金资产净值及 A 类基金份额和 B 类基金份额的每万份基金净收益和基金 7 日年化收益率、E 类基金份额的每百份基金净收益和 7 日年化收益率；

（13）严格按照《基金法》等相关法律法规和基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（14）按照法律法规、基金合同及其他有关规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）按基金合同的约定确定基金收益方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（16）保守基金的商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等；除法律法规和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。但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其它监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露或为了基金审计目的而作出的披露不应视为基金管理人违反基金合同约定的保密义务；

（17）依据法律法规、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；

（18）按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（19）组织并参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（21）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）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，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（23）确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（24）负责为基金聘请注册会计师和律师；

（25）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者实施其他法律行为；

（26）基金合同不能生效时按规定退还所募集资金本息，并承担发行费用；

（27）公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人利益的行为及进行不公平的资源分配；

（28）不从事任何有损本基金其他当事人合法权益的活动；

（29）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它义务。

（三）基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

（3）监督本基金的投资运作，如发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规规定，且投资指令未生效的，不予执行并通知基金管理人及向中国证监会报告；若投资指令违反基金合同或有关法律法规规定，且投资指令依据交易程序已生效的，应立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告；

（4）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据法律法规、基金合同及其他有关规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同约定，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取其他必要措施以保护基金份额持有人的利益；

（7）法律法规、基金合同约定的其它权利。

2、基金托管人的义务

（1）遵守基金合同；

（2）依法持有基金财产；

（3）以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

（4）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、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；

（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，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资产以及不同的基金财产相互独立；对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；

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；

（7）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；

（8）按照相关规定开设基金财产的资金账户、证券账户和银行间债券托管账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

（9）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应予保密，不得向他人泄露；

（10）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、A 类基金份额和 B 类基金份额的每万份基金净收益和基金 7 日年化收益率、E 类基金份额的每百份基金净收益和 7 日年化收益率；

（11）采用适当、合理的措施，使本基金份额的认购、申购、赎回和转换等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

（12）采用适当、合理的措施，使基金管理人用以计算本基金份额的认购、申购、赎回和基金转换的方法符合本基金合同等有关法律文件的规定；

（13）采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合法律法规、基金合同的规定；

（14）对基金财务会计报告、中期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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（15）按照法律法规和中国证监会有关规定出具基金托管人报告；

（16）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（17）按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；

（18）依基金管理人指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（19）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（20）参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（21）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

（22）因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（23）监督基金管理人按照基金合同规定履行义务，基金管理人因过错造成基金财产损失时，托管人应为基金向基金管理人追偿；

（24）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（25）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（26）有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一份 A 类基金份额和每一份 B 类基金份额拥有平等的投票权，持有的每一份 E 类基金份额与每 100 份 A 类/每 100 份 B 类基金份额拥有平等的投票权。

为体现基金份额持有人的权益，本基金合同第八部分、第九部分及基金合同其他条款涉及基金份额持有人提议召集权、召集权、计算到会或出具表决意见的持有人所代表的基金份额数量、表决权等需要统计基金份额持有人所持份额及其占总份额比例时，每一份 E 类基金份额均与每 100 份 A 类/B 类基金份额代表同等权利。

本部分所涉及数字，含有“以上”表述的，均不包括该数字在内；含有“不少于”表述的，均包含该数字在内。

（一）召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10%以上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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

1、提前终止基金合同；

2、转换基金运作方式；

3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；

4、更换基金管理人、基金托管人；

5、变更基金类别；

6、变更基金投资目标、范围或策略；

7、变更基金份额持有人大会程序；

8、对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的事项；

9、《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费、基金托管费和销售服务费；

2、在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金份额的收费方式；

3、因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；

4、对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5、对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6、因相应上海证券交易所或者注册登记机构的与 E 类基金份额相关的业务规则发生变动，需要对基金合同进行修改；

7、除法律法规或本基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

（二）召集人和召集方式

除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在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；

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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

代表基金份额 10％以上的基金份额持有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；

代表基金份额 10％以上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、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10％以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

（1）会议召开时间、地点、方式；

（2）会议审议事项、议事程序、表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）代理投票委托书送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名、电话；

（6）其他注意事项。

如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

会议方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；

（3）通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；

（4）会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会召开条件

（1）现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当不少于在代表权益登记日基金总份额的 50%；

2）到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 15 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

（2）通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上；

4）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表，同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 15 个工作日后)，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

（五）议事内容与程序

议事内容及提案权

（1）议事内容仅限于本基金合同第七部分“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

（2）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决；

（3）基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有

人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；

（4）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1）关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明；

2）程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10％以上的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

（六）决议形成的条件、表决方式、程序

1、决议形成的条件、表决方式

（1）基金份额持有人所持每份 A 类基金份额或 B 类基金份额享有一票表决权，所持每一份 E 类基金份额具有 100 票表决权。

（2）基金份额持有人不得就未经公告的事项进行表决。

（3）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1）一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效；除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议

的方式通过；

2）特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 2/3 以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（4）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（5）对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（6）基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

2、计票

（1）现场开会

如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人；

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果，并由公证机关对其计票过程予以公证；

如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（七）公告时间与方式

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自基金份额持有人大会决议表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒介公告。

基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、本基金每日将 A 类基金份额和 B 类基金份额的基金净收益分配给相应的基金份额持有人（该收益将于下一工作日会计确认为实收基金）。通常情况下，本基金每月集中支付收益，结转为相应的基金份额；对于可支持按日支付的销售机构，本基金的收益支付方式经基金管理人与销售机构协商一致后可以在不损害基金份额持有人权益的前提下实施按日支付。无论何种支付方式，当日收益均参与下一日的收益分配，不影响基金份额持有人实际获得的投资收益。收益分配计算结果计算至小数点后第二位，投资者当日收益的精确度为小数点后两位，小数点后第三位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配。

如需召开基金份额持有人大会,为确保基金份额持有人的表决权体现其持有的全部权益,基金管理人将于召开基金份额持有人大会的权益登记日当日统一为所有销售机构的基金份额持有人结转相应的基金份额。

2、本基金每日将 E 类基金份额的基金净收益分配给相应的基金份额持有人，并记入 E 类基金份额持有人的收益账户（该收益将于下一工作日会计确认为实收基金），当日收益参与下一日的收益分配。若 E 类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应 E 类基金份额。收益分配计算结果计算至小数点后第二位，投资者当日收益的精确度为小数点后两位，小数点后第三位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配。

3、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益。

4、本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，收益分配只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。对于按月支付的情形，若 A 类基金份额和 B 类基金份额当月累计分配的基金收益为正，则为持有人增加相应的基金份额；若当月累计分配的基金收益为负，则为持有人缩减相应的基金份额。对按日支付的情形，若 A 类基金份额和 B 类基金当日分配的基金收益为正，则为持有人增加相应的基金份额；若当日分配的基金收益为负，则为持有人缩减相应的基金份额。投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。

5、对按月支付收益的情形，在 A 类基金份额持有人或 B 类基金份额持有人全部赎回基金份额时，其账户在当月累计的基金收益将立即结清，并随赎回款项一起支付给投资者，若当月累计的基金收益为负，则扣减赎回金额；在 A 类基金份额持有人或 B 类基金份额持有人部分赎回基金份额时，不结算基金收益，而是待全部赎回时再一并结算基金收益。对按日支付收益的情形，在 A 类基金份额持有人或 B 类基金份额持有人全部赎回基金份额时，其

账户在当日的基金收益将立即结算，并随赎回款项一起支付给投资者，若当日的基金收益为负，则扣减赎回金额；在 A 类基金份额持有人或 B 类基金份额持有人部分赎回基金份额时，不结算基金收益，而是待全部赎回时再一并结算基金收益。在 E 类基金份额持有人赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资人，如累计的基金收益为负，则扣减赎回金额。

6、基金份额持有人部分卖出 E 类基金份额时，不支付对应的收益，全部卖出 E 类基金份额时，以现金方式将全部累计收益与基金份额持有人结清。若累计收益为负，则投资人应当以现金方式全部弥补，否则基金管理人有权向基金份额持有人追索相应收益及损失。

7、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。当日买入的 E 类基金自买入当日起享有基金的分配权益；当日卖出的 E 类基金份额自卖出当日起，不享有基金的分配权益。

8、同一基金类别的每份基金份额享有同等分配权。

9、在不影响基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可酌情调整本基金收益分配方式，此项调整并不需要基金份额持有人大会决议通过。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案的确定与公告

本基金按日分配收益，基金管理人不另行公告。

基金收益计算方法为：

1、A 类/B 类基金份额日每万份基金净收益=[当日该类基金份额基金净收益/当日该类基金份额总额]×10000；

E 类基金份额的日每百份基金净收益=[当日 E 类基金份额的基金净收益/当日 E 类基金份额总额]×100；

上述收益的精度为 0.0001 元，第五位采用四舍五入的方式。

2、A类/B类基金份额期间每万份基金净收益＝$\sum_{w=1}^{n}(r_w / S_w)\times 10000$；

其中，r1 为期间首日 A 类基金份额或 B 类基金份额基金净收益，S1 为期间首日 A 类基金份额或 B 类基金份额的基金份额总额，rw 为第 w 日 A 类基金份额或 B 类基金份额基金净收益，Sw 为第 w 日 A 类基金份额或 B 类基金份额的基金份额总额，rn 为期间最后一日 A 类基金份额或 B 类基金份额基金净收益，Sn 为期间最后一日 A 类基金份额或 B 类基金份额的基金份额总额。

E 类基金份额期间每百份基金净收益=$\sum_{w=1}^{n}(r_w / S_w)\times 100$；

其中，r1 为期间首日 E 类基金份额净收益，S1 为期间首日 E 类基金份额总额，rw 为

第 w 日 E 类基金份额净收益，Sw 为第 w 日 E 类基金份额总额，rn 为期间最后一日 E 类基金份额净收益，Sn 为期间最后一日 E 类基金份额总额。

3、7 日年化收益率＝$\left\{\left[\prod_{i=1}^{7}\left(1+\frac{R_i}{10000}\right)\right]^{365/7}-1\right\}\times 100\%$；

其中，Ri 为最近第 i 个自然日（包括计算当日）的 A 类基金份额或 B 类基金份额每万份基金净收益或 E 类基金份额每百份基金净收益。7 日年化收益率保留至小数点后第 3 位。

4、本基金收益根据本基金合同规定的分配原则进行分配，收益公告由基金管理人编制，经基金托管人复核，每开放日公告一次，披露公告截止日前一个开放日 A 类基金份额和 B 类基金份额每万份基金净收益及 7 日年化收益率、E 类基金份额每百份基金净收益及 7 日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的 A 类基金份额和 B 类基金份额每万份基金净收益和节假日最后一日的 7 日年化收益率、E 类基金份额每百份基金净收益和节假日最后一日的 7 日年化收益率，以及节假日后首个开放日的 A 类基金份额和 B 类基金份额每万份基金净收益和 7 日年化收益率、E 类基金份额每百份基金净收益和 7 日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。对上述事项，法律法规有新的规定时，基金管理人应按新的规定作出调整。

（三）基金收益分配中发生的费用

收益分配采用红利再投资方式，免收再投资的费用；基金份额持有人赎回基金份额时发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金管理人的管理费

（1）费率：年费率 0.33%

（2）计提标准：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

（3）计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。每月前 5 个工作日内，由基金管理人向基金托管人发送上月基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。。

2、基金托管人的基金托管费

（1）费率：年费率 0.10%

（2）计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%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

（3）计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。每月前 5 个工作日内由基金管理人向基金托管人发送上月基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

本基金各类基金份额按照一定的费率计提销售服务费，A 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.25%年费率计提，B 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.01%年费率计提，E 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.25%年费率计提。

本基金销售服务费计提的计算方法如下：

H＝E×R÷当年天数

H 为各类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的销售服务费率

基金销售服务费每日计提，按月支付。每月前 5 个工作日内，由基金管理人向基金托管人发送上月基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人指定的基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、其他费用

上述“一、基金费用的种类”中 4 到 10 项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额，列入当期基金费用，从基金财产中支付。上述“一、基金费用的种类”中第 9 项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额，列入 E 类基金份额的当期基金费用，从基金财产中支付。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资方向

本基金主要投资于货币市场工具，包括：现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

（二）投资限制

1、本基金不得投资以下金融工具：

（1） 股票；

（2） 可转换债券、可交换债券；

（3） 剩余期限超过 397 天的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；

（4） 信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；

（5）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；

（6）在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

（7） 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金的基金财产不得用于下列投资或活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人提供贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会、中国人民银行规定禁止的其他投资或活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

六、基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金财产总值扣除负债后的净资产值。

其构成主要有：

1、基金份额持有人申购、赎回基金份额所发生的款项；

2、运用基金财产所获得收益（亏损）；

3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的变更

1、基金合同内容发生如下情形变更，须召开基金份额持有人大会：

（1）变更基金投资目标、范围或策略；

（2）更换基金管理人、基金托管人；

（3）变更基金份额持有人大会程序；

（4）转换基金运作方式；

（5）变更基金类别；

（6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（7）法律法规及中国证监会规定的其他情形。

基金份额持有人大会决议通过的以上基金合同变更，召集人应自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

2、除上述第 1 条规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同进行变更，基金管理人和基金托管人对基金合同的内容进行变更应当报中国证监会备案并按本基金合同的规定进行公告。

（二）基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）基金合同约定的其他情形；

（4）中国证监会允许的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算组对基金财产进行清算。

（三）基金财产的清算

1、清算小组

（1）自基金合同终止之日起 3 个工作日内成立基金财产清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。

（3）清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、清算程序

（1）基金合同终止后，由清算小组统一接管基金资产；

（2）清算小组对基金资产进行清理和确认；

（3）对基金资产进行估价；

（4）对基金资产进行变现；

（5）将基金清算结果报告中国证监会；

（6）公布基金清算公告；

（7）进行基金剩余资产的分配。

3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从基金资产中支付。

4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配（基金份额持有人持有的每一份 A 类基金份额和每一份 B 类基金份额拥有平等的分配权，持有的每一份 E 类基金份额与每 100 份 A 类/每 100 份 B 类基金份额拥有平等的分配权）。

5、基金清算的公告

清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后 5 个工作日由清算小组公告。

6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存 15 年以上。

八、争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人和基金托管人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会并根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本基金合同的其他规定。

3、基金份额持有人或基金投资者作为一方当事人与基金管理人、基金托管人的一方或数方作为另一方当事人之间发生争议，首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权向有管辖权的人民法院起诉，也可将事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册并对外公开散发或存放在基金管理人和基金托管人的营业场所供投资者免费查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。