

亚债中国债券指数基金

招募说明书

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

亚债中国债券指数基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2011年3月14日证监许可[2011]392号文核准募集。

基金管理人保证本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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人大量赎回基金产生的流动性风险，本基金的特定风险等。本基金是债券基金，风险高于货币市场基金，低于混合基金和股票基金，属于较低风险、较低收益的品种。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪守诚信、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人应当遵守基金合同的规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金管理人管理基金资产，必须恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务。

目录

| | |
|----------------------------|----|
| 一、绪言..... | 1 |
| 二、释义..... | 1 |
| 三、基金管理人..... | 5 |
| 四、基金托管人..... | 11 |
| 五、相关服务机构..... | 14 |
| 六、基金的募集..... | 43 |
| 七、基金合同的生效..... | 46 |
| 八、基金份额的申购、赎回与转换..... | 47 |
| 九、基金的转托管与非交易过户等其他业务..... | 53 |
| 十、基金的投资..... | 54 |
| 十一、基金的财产..... | 58 |
| 十二、基金资产的估值..... | 58 |
| 十三、基金的收益与分配..... | 60 |
| 十四、基金的费用与税收..... | 62 |
| 十五、基金的会计与审计..... | 64 |
| 十六、基金的信息披露..... | 64 |
| 十七、风险揭示..... | 67 |
| 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 70 |
| 十九、基金合同的内容摘要..... | 71 |
| 二十、基金托管协议的内容摘要..... | 71 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务..... | 71 |
| 二十二、其他应披露事项..... | 74 |
| 二十三、招募说明书存放及查阅方式..... | 75 |
| 二十四、备查文件..... | 75 |
| 附件一 基金合同摘要..... | 76 |
| 附件二 基金托管协议摘要..... | 88 |

一、绪言

《亚债中国债券指数基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”及其他有关规定以及《亚债中国债券指数基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利、义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

| | |
|---------|-------------------------------------|
| 基金或本基金： | 指亚债中国债券指数基金； |
| 基金合同： | 指《亚债中国债券指数基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充； |
| 托管协议： | 指《亚债中国债券指数基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充； |
| 招募说明书： | 指《亚债中国债券指数基金招募说明书》及基金管理人对其定期做出的更新； |
| 发售公告： | 指《亚债中国债券指数基金基金份额发售公告》； |
| 中国证监会： | 指中国证券监督管理委员会； |

- 中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时做出的修订；
- 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及立法机关对其不时做出的修订；
- 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及立法机关对其不时做出的修订；
- 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及立法机关对其不时做出的修订；
- 《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日经中华人民共和国第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 基金合同当事人：指受基金合同约定，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
- 基金管理人：指华夏基金管理有限公司；
- 基金托管人：指交通银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：指依照法律法规或基金合同合法取得并持有基金份额的投资者；
- 登记结算业务：指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务。具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 登记结算机构：指办理基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为华夏基金管理有限公司或接受华夏基金管理有限公司委托代为办理基金登记结算业务的机构；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团

| | |
|------------|--|
| | 体或其它组织； |
| 合格境外机构投资者： | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定，经中国证监会批准可以投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者； |
| 重大利害关系人： | 受基金管理人或基金托管人控股股东控制的证券发行人； |
| 基金募集期： | 指自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月的期间； |
| 基金合同生效日： | 指基金达到法定的基金备案条件，基金管理人向中国证监会办理备案手续并获得中国证监会书面确认之日； |
| 基金存续期： | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限； |
| 认购： | 指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为； |
| 申购： | 指在基金合同生效后的存续期间，投资者按基金合同规定的条件，申请购买本基金基金份额的行为； |
| 赎回： | 指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为； |
| 基金转换： | 指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人规定的条件，申请将其持有的某一基金（包括本基金）的基金份额转为由基金管理人管理的、由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金（包括本基金）份额的行为； |
| 销售机构： | 指直销机构及本基金代销机构； |
| 直销机构： | 指华夏基金管理有限公司； |
| 代销机构： | 指接受基金管理人委托代为办理本基金销售业务的具有基金代销业务资格的机构； |
| 基金销售网点： | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点； |
| 基金账户： | 指登记结算机构为基金投资者开立的记录其持有的由该登记结算机构办理登记结算的基金份额余额及其变动情况的账户； |
| 交易账户： | 指销售机构为基金投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金基金份额变动及其余额情况的账户； |
| 销售服务费： | 指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用； |

| | |
|---------|--|
| 基金份额类别: | 指根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值; |
| 标的指数: | 指 Markit 指数公司编制并发布的 iBoxx [®] 亚债中国指数及其未来可能发生的变更、或根据需要更换的其他债券市场指数; |
| 成份券: | 指构成标的指数的债券; |
| 元: | 指人民币元; |
| 工作日: | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日; |
| 开放日: | 指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日; |
| T 日: | 指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的开放日; |
| T+n 日: | 指 T 日后(不包括 T 日)的第 n 个工作日, n 指自然数; |
| 基金收益: | 指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约; |
| 基金资产总值: | 指本基金拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和; |
| 基金资产净值: | 指基金资产总值减去基金负债后的价值; |
| 基金份额净值: | 指各个基金份额类别单独计算的基金份额净值,计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数; |
| 基金资产估值: | 指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程; |
| 指定媒体: | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站; |
| 法律法规: | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充; |
| 业务规则: | 指《华夏基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记结算方面的业务规则,由基金管理人和基金投资者共同遵守; |

不可抗力：指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：范勇宏

联系人：崔雁巍

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

| 持股单位 | 持股占总股本比例 |
|------------|----------|
| 中信证券股份有限公司 | 100% |
| 合计 | 100% |

（二）主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

王东明先生：董事长，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、中国中信集团公司董事、总经理助理，中信控股有限责任公司董事、中信国际金融控股有限公司董事、中信资本市场控股有限公司董事、中信证券国际有限公司董事。曾任中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事，北京华远经济建设公司副总经理，加拿大枫叶银行证券公司部门副经理，华夏证券公司发行部副总经理，南方证券公司副总裁等职务。

范勇宏先生：董事、总经理，博士。曾任华夏证券股份有限公司总裁助理、华北业务总监、华夏证券股份有限公司北京东四营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王连洲先生：独立董事，学士。现已退休。《证券法》、《信托法》、《基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在全国人大财经委员会和中国人民银行总行印制管理局工作。

龙涛先生：独立董事，硕士。现任海问投资咨询有限责任公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计纽约分部从事审计和财务分析工作。

涂建先生：独立董事，学士。现任太平洋证券股份有限公司党委书记。曾任中国国际贸易促进委员会资产监督管理委员会资产管理中心主任。

滕天鸣先生：执行副总经理，硕士。曾任公司总经理助理和机构理财部总经理等。

王亚伟先生：副总经理，硕士。现任华夏大盘精选证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张后奇先生：副总经理，博士。曾任公司总经理助理。

方瑞枝女士：督察长，硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生：监事，硕士。现任西南证券股份有限公司研究发展中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。曾任江苏联合信托投资有限公司研究发展部研究员、上海分部经理。

张鸣溪先生：监事，学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任北京证券有限责任公司投资银行部执行总经理、财务总监，华夏证券股份有限公司并购业务管理部常务副总经理、计划财务部副总经理、投资银行总部副总经理，中华会计师事务所注册会计师。

瞿颖女士：监事，硕士，中国注册会计师协会非执业会员。现任华夏基金管理有限公司稽核部总经理助理。曾就职于安永华明会计师事务所、泰康人寿保险公司。

2. 本基金基金经理

董元星先生，美国纽约大学Stern商学院金融学博士。曾任巴克莱资本（纽约）债券交易员。2009年加入华夏基金管理有限公司。

3. 本公司固定收益投资决策委员会

杨爱斌先生：华夏基金管理有限公司固定收益总监。

张后奇先生：华夏基金管理有限公司副总经理。

韩会永先生：华夏基金管理有限公司固定收益副总监，华夏债券投资基金基金经理，华夏希望债券型证券投资基金基金经理。

唐俊先生：华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理，投资经理。

刘鲁旦先生：华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理，投资经理。

4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4.按照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收益；
- 5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6.编制中期和年度基金报告；
- 7.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9.召集基金份额持有人大会；
- 10.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；
- 11.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；
- 12.国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1.本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2.本基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3.本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- （1）向他人贷款或者提供担保；
- （2）从事承担无限责任的投资；
- （3）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （4）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （5）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他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；
- （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，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

4.本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

5. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取利益。
- (2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(五) 基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、操作控制、信息沟通、内部稽核等要素。

1. 控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1) 公司建立了科学的公司治理结构，在业界最早引入了独立董事制度，目前有独立董事3名。董事会下设资格审查委员会、薪酬委员会、审计委员会等专业委员会，其中审计委员会负责评价与完善公司内部控制体系。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

(2) 公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相核对和制衡，形成了合理的组织结构。

(3) 公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的职业道德的培养，制定和颁布了《员工合规行为守则》，并进行持续教育。

2. 风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的不利因素（即风险）进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风

险控制制度。

3.操作控制

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上，做到了业务操作流程的科学、合理和标准化，并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核；在岗位责任制度上，内部岗位分工合理、职责明确，不相容的职务、岗位分离设置，相互检查、相互制约。

（1）投资控制制度

①投资决策与执行相分离。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例，在债券基金投资方面，投资决策委员会负责制订基金投资组合的久期和类属配置政策，基金经理在投资决策委员会确定的范围内，负责确定与实施投资策略、进行具体的证券选择、构建和调整投资组合并下达投资指令，交易管理部交易员负责交易执行。

②投资决策权限控制。基金经理对单只证券投资超过一定比例的，须提交书面报告，经投资总监或投资决策委员会（视投资比例而定）批准后才能执行。

③警示性控制。交易管理部对有问题的交易指令进行预警，并在投资组合中各类资产的投资比例将达到法规和公司规定的比例限制时进行预警。交易管理部发现该类指令时，向投资总监和监察稽核部门及时提出警示，基金经理须及时向投资总监和监察稽核部门说明情况，投资总监和监察稽核部门判断是否违规及是否停止交易。对投资比例的预警是通过交易系统设置各类资产投资比例的预警线，在达到接近限制比例前的某一数值时，系统自动预警，交易管理部及时向基金经理反馈预警情况。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司规定的禁止行为，制定证券投资限制表，包括受限制的证券和受限制的行为。基金经理构建组合时不能突破这些限制，同时交易管理部对此进行监控，通过预先的设定，交易系统能对这些情况进行自动提示和限制。

⑤一致性控制。对基金经理下达的投资交易指令、交易员输入交易系统的交易指令和基金会计成交回报进行一致性复核，确保交易指令得到准确执行。

⑥多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控（包括上述警示性控制和禁止性控制）。交易管理部本身同时受投资总监、基金经理及监察稽核的三重监控：投资总监监控交易指令的正确执行和交易管理部监控职能的有效发挥；基金经理监控交易指令的正确执行；监察稽核部门监控有问题的交易。

（2）会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程，确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

(3) 技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

(4) 人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度,确保人力资源的有效管理。

(5) 监察制度

公司设立了独立的法律监察部门,负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度,以及对员工行为的监察。

(6) 反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构,指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作;各相关部门设立了反洗钱岗位,配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外,公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程,确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

4. 信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司所有业务均已做到了办公自动化,不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

5. 内部稽核

公司设立了独立于各业务部门的稽核部,内部稽核人员定期检查和评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司各项内部控制制度的执行情况并提出相应的修改意见。

6. 基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;
- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确;
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：562.59亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。根据英国《银行家》杂志公布的2009年全球1000家银行排名，交通银行总资产排名位列第56位，一级资本排名位列第49位。截止2010年12月末，交通银行资产总额超过人民币3.95万亿元，2010年实现净利润人民币390.42亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主

任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止2011年3月末，交通银行共托管证券投资基金52只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票（LOF）、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合（LOF）、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票（LOF）、万家公用事业行业股票（LOF）、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过七千亿元。

（四）基金托管人的内部控制制度

1. 内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

2. 内部控制原则

（1）全面性原则：通过各个处室自我监控和专门内控处室的风险监控的内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

（2）独立性原则：交通银行资产托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金分别设置账户，独立核算，分账管理。

(3) 制衡性原则：贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各处室和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

(4) 有效性原则：在岗位、处室和内控处室三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

(5) 效益性原则：内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

3.内部控制制度及措施

根据《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部内部风险控制制度》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》、《交通银行资产托管部监察守则》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

4.其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

(五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。

基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

（一）销售机构

1.直销机构：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层

法定代表人：范勇宏

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：吴志军

网址：www.ChinaAMC.com

2.代销机构

（1）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

客户服务电话：95559

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：田耕

网址：www.icbc.com.cn

(3) 中国农业银行股份有限公司

住所：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：项俊波

客户服务电话：95599

传真：010-85109219

联系人：滕涛

网址：www.abchina.com

(4) 中国银行股份有限公司

住所：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：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

联系人：客户服务中心

网址：www.boc.cn

客户服务电话：95566

(5) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王琳

网址：www.ccb.com

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63602431

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

(7) 深圳发展银行股份有限公司

住所：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

电话：0755-82088888

传真：0755-25841098

联系人：张青

网址：www.sdb.com.cn

客户服务电话：95501

(8) 中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区西单教育街三号西楼 11 层

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

(9) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

电话：010-68858095

传真：010-68858116

联系人：陈春林

网址：www.psbc.com

客户服务电话：95580

（10）北京银行股份有限公司

住所：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

客户服务电话：95526

传真：010-66226045

联系人：王曦

网址：www.bankofbeijing.com.cn

（11）华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：010-85238670

传真：010-85238680

联系人：李慧

网址：www.hxb.com.cn

客户服务电话：95577

（12）上海银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：陈辛

电话：021-68475888

传真：021-68476111

联系人：张萍

网址：www.bankofshanghai.com

客户服务电话：021-962888

（13）宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528

传真：021-63586215

联系人：胡技勋

网址：www.nccb.com.cn

（14）上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层

法定代表人：胡平西

客户服务电话：021-962999

传真：021-50105124

联系人：吴海平

网址：www.shrcb.com

（15）青岛银行股份有限公司

住所：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

办公地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

法定代表人：张广鸿

客户服务电话：96588（青岛）、400-669-6588（全国）

传真：0532-85709839

联系人：滕克

网址：www.qdccb.com

（16）徽商银行股份有限公司

住所：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

办公地址：合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：王晓昕

电话：0551-2667819

传真：0551-2667684

联系人：王祎

网址：www.hsbank.com.cn

客户服务电话：400-889-6588(安徽省外)、96588(安徽省内)

(17) 东莞银行股份有限公司

住所：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

电话：13316603168

传真：0769-22117730

联系人：胡昱

网址：www.dongguanbank.cn

客户服务电话：0769-96228

(18) 杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

联系人：陈振峰

网址：www.hzbank.com.cn

客户服务电话：400-888-8508

(19) 南京银行股份有限公司

住所：南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：林复

电话：025-84544021

传真：025-84544129

联系人：翁俊

网址：www.njcb.com.cn

客户服务电话：400-889-6400

(20) 临商银行股份有限公司

住所：山东省临沂市沂蒙路 336 号

办公地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号

法定代表人：王傢玉

电话：0539-8304657

传真：0539-8051127

联系人：寇廷柱

网址：www.lsbchina.com

客户服务电话：400-699-6588

（21）温州银行股份有限公司

住所：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

法定代表人：夏瑞洲

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

联系人：林波

网址：www.wzbank.cn

客户服务电话：96699（浙江和上海地区）、0577-96699（其他地区）

（22）汉口银行股份有限公司

住所：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦

办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦

法定代表人：陈新民

电话：027-82656224

传真：027-82656236

联系人：骆芸

网址：www.hkbchina.com

客户服务电话：027-96558(武汉本地)、400-609-6558

（23）洛阳银行股份有限公司

住所：洛阳市洛阳新区开元大道与通济街交叉口

办公地址：洛阳市洛阳新区开元大道与通济街交叉口

法定代表人：王建甫

电话：0379-65921977

传真：0379-65920155

联系人：胡艳丽

网址：www.bankofluoyang.com.cn

客户服务电话：0379-96699

（24）乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

住所：乌鲁木齐市新华北路 8 号

办公地址：乌鲁木齐市新华北路 8 号

法定代表人：农惠臣

电话：0991-8824667

传真：0991-8824667

联系人：何佳

网址：www.uccb.com.cn

客户服务电话：0991-96518

（25）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045446

传真：010-66045500

联系人：潘鸿

网址：www.txsec.com

客户服务电话：010-66045678

（26）国泰君安证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：韩星宇

网址：www.gtja.com

客户服务电话：021-962588、400-888-8666

(27) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(28) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 9 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

(29) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：400-888-8111、95565

(30) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575 或致电各营业网点

（31）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：010-84588266

传真：010-84865560

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：各地营业部咨询电话

（32）中国银河证券股份有限公司

住所：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：顾伟国

电话：010-66568430

传真：010-66568536

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：400-888-8888

（33）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：www.htsec.com

客户服务电话：021-962503、400-888-8001 或拨打各城市营业网点咨询电话

（34）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82493561

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

网址：www.lhzq.com

客户服务电话：95513

（35）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54030294

联系人：李清怡

网址：www.sw2000.com.cn

客户服务电话：021-962505

（36）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：400-888-8123

(37) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481100

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：95579、400-888-8999

(38) 安信证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

客户服务电话：400-800-1001

(39) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

法定代表人：王珠林

客户服务电话：023-63786397

传真：023-63786312

联系人：杨卓颖

网址：www.swsc.com.cn

(40) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：0571-85783715

传真：0571-85783771

联系人：王勤

网址：www.bigsun.com.cn

客户服务电话：0571-96598

（41）湘财证券有限责任公司

住所：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

电话：021-68634518-8631

传真：021-68865680

联系人：李梦诗

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：400-888-1551

（42）万联证券有限责任公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

办公地址：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

法定代表人：李舫金

电话：020-37865070

传真：020-37865008

联系人：罗创斌

网址：www.wlzq.com.cn

客户服务电话：400-8888-133

（43）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207938

传真：0551-2634400-1171

联系人：祝丽萍

网址：www.gyzq.com.cn

客户服务电话：全国：400-888-8777、安徽地区：96888

（44）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

网址：www.bhzq.com

客户服务电话：400-651-5988

（45）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

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

电话：025-84457777-893

传真：025-84579879

联系人：程高峰

网址：www.htsc.com.cn

客户服务电话：400-888-8168、025-84579897

（46）山西证券股份有限公司

住所：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

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

客户服务电话：400-666-1618

(47) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

网址：www.zxwt.com.cn

客户服务电话：0532-96577

(48) 东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：www.dwzq.com.cn

客户服务电话：0512-33396288

(49) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

电话：010-88656100

传真：010-88656290

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：400-800-8899

(50) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

网址：www.dfzq.com.cn

客户服务电话：95503

（51）方正证券有限责任公司

住所：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

电话：13857135668

传真：0571-87782011

联系人：邢铁英

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（52）长城证券有限责任公司

住所：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：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

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

联系人：匡婷

网址：www.cgws.com

客户服务电话：0755-33680000、400-666-6888

（53）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169089

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：10108998、400-888-8788

（54）广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼六楼

法定代表人：吴志明

电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：樊刚正

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：020-961303

（55）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096709

传真：0431-85096795

联系人：潘锴

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

（56）南京证券有限责任公司

住所：南京市鼓楼区大钟亭 8 号

办公地址：南京市鼓楼区大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

客户服务电话：025-83364032

传真：025-83364032

联系人：石健

网址：www.njzq.com.cn

(57) 上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：蒋元真

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：谢秀峰

网址：www.962518.com

客户服务电话：021-962518

(58) 新时代证券有限责任公司

住所：北京市西城区月坛大厦 15 层

办公地址：北京市西城区月坛大厦 15 层

法定代表人：马金声

客户服务电话：010-68084591

传真：010-68084986

联系人：戴荻

网址：www.xsdzq.cn

(59) 大同证券经纪有限责任公司

住所：山西省大同市大北街 13 号

办公地址：山西省太原市青年路 8 号

法定代表人：董祥

客户服务电话：0351-4167056

传真：0351-4192803

联系人：苏妮

网址：www.dtsbc.com.cn

(60) 国联证券股份有限公司

住所：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 号国联大厦 6-8 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

网址：www.glsc.com.cn

客户服务电话：400-888-5288

（61）浙商证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6-7

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6-7

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

网址：www.stocke.com.cn

客户服务电话：967777

（62）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

电话：0755-22626172

传真：0755-82400862

联系人：周璐

网址：www.pingan.com

客户服务电话：400-881-6168

（63）华安证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市长江中路357号

办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座

法定代表人：李工

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

联系人：甘霖

网址：www.hazq.com

客户服务电话：0551-96518、400-809-6518

(64) 国海证券有限责任公司

住所：广西南宁市滨湖路 46 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：0771-5539262

传真：0771-5539033

联系人：覃清芳

网址：www.ghzq.com.cn

客户服务电话：全国：400-888-8100、广西：96100

(65) 财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27、28 楼

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403319

传真：0731-4403349

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

(66) 东莞证券有限责任公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

电话：0769-22119426、0769-22119351

传真：0769-22119423

联系人：张建平、罗绍辉

网址：www.dgzq.com.cn

客户服务电话：0769-961130

(67) 中原证券股份有限公司

住所：郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦

办公地址：郑州市经三路 15 号广汇国贸 11 楼

法定代表人：石保上

电话：0371-65585670

传真：0371-65585665

联系人：程月艳、耿铭

网址：www.ccnew.com

客户服务电话：967218、400-813-9666

（68）国都证券有限责任公司

住所：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

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（69）东海证券有限责任公司

住所：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：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：李涛

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：021-52574550、0519-88166222、0379-64902266、400-888-8588

（70）国盛证券有限责任公司

住所：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升

客户服务电话：0791-6285337

传真：0791-6288690

联系人：徐美云

网址：www.gsstock.com

（71）宏源证券股份有限公司

住所：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

电话：010-88085201

传真：010-88085195

联系人：李巍

网址：www.hysec.com

客户服务电话：400-800-0562

（72）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283906

传真：0531-81283900

联系人：吴阳

网址：www.qlzq.com.cn

客户服务电话：95538

（73）第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址：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

电话：0755-25832494

传真：0755-25831718

联系人：王立洲

网址：www.fcsc.cn

客户服务电话：0755-25832523

(74) 金元证券股份有限公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025666

传真：0755-83025625

联系人：金春

网址：www.jyzq.cn

客户服务电话：400-888-8228

(75) 中航证券有限公司

住所：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

网址：www.avicsec.com

客户服务电话：400-886-6567

(76) 华林证券有限责任公司

住所：珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5 楼

法定代表人：段文清

电话：0755-82707853

传真：0755-82707850

联系人：骆扬

网址：www.chinalions.com

客户服务电话：各地营业部客户服务电话

(77) 德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：400-888-8128

（78）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼

法定代表人：刘建武

电话：029-87406488

传真：029-87406387

联系人：冯萍

网址：www.westsecu.com.cn

客户服务电话：029-95582

（79）广发华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

网址：www.gfhfzq.com.cn

客户服务电话：0591-96326

（80）华龙证券有限责任公司

住所：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

电话：0931-4890100

联系人：李昕田

网址：www.hlzqgs.com

客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

(81) 中国国际金融有限公司

住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉

网址：www.cicc.com.cn

客户服务电话：010-65051166

(82) 财通证券有限责任公司

住所：杭州市解放路111号金钱大厦

办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

电话：0571-87925129

传真：0571-87828042

联系人：乔骏

网址：www.ctsec.com

客户服务电话：0571-96336

(83) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5045号深业大厦25层2512、2513

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01

法定代表人：王文学

电话：021-64339000-826、021-64374864

传真：021-64374864

联系人：杨小江

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999、029-68918888

(84) 瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

电话：010-58328752、010-58328725

传真：010-58328748

联系人：谢亚凡

网址：www.ubssecurities.com

客户服务电话：400-887-8827

（85）中国建银投资证券有限责任公司

住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

办公地址：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 层至 20 层

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026521

传真：0755-82026539

联系人：刘权

网址：www.cjis.cn

客户服务电话：400-600-8008

（86）中山证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

电话：0755-82570586

传真：0755-82960582

联系人：李珍

网址：www.zszq.com

客户服务电话：400-102-2011

（87）西藏同信证券有限责任公司

住所：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

网址：www.xzsec.com

客户服务电话：400-881-1177

（88）日信证券有限责任公司

住所：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

电话：010-88086830

传真：010-66412537

联系人：陈韦杉

网址：www.rxzq.com.cn

客户服务电话：010-88086830

（89）江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

联系人：徐世旺

网址：www.jhzq.com.cn

客服电话：400-666-2288

（90）厦门证券有限公司

住所：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人：傅毅辉

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

联系人：卢金文

网址：www.xmzq.cn

客户服务电话：0592-5163588

(91) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

法定代表人：张建华

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：陈敏

网址：www.ajzq.com

客户服务电话：021-63340678

(92) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区月坛北街 26 号

办公地址：北京市西城区月坛北街 26 号

法定代表人：丁之锁

电话：010-58568007

传真：010-58568062

联系人：梁宇

网址：www.hrsec.com.cn

客户服务电话：010-58568118

(93) 天风证券有限责任公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

电话：027-87618882

传真：027-87618863

联系人：翟璟

网址：www.tfzq.com

客户服务电话：028-86711410、027-87618882

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加

或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

(二) 登记结算机构

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层

法定代表人：范勇宏

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：张金锋

(三) 律师事务所

名称：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座十二层

办公地址：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座十二层

负责人：王丽

联系电话：010-52682888

传真：010-52682999

联系人：李晓明

经办律师：徐建军、李晓明

(四) 会计师事务所

本公司聘请的法定验资机构为德勤华永会计师事务所有限公司。

名称：德勤华永会计师事务所有限公司

住所：上海市延安东路222号外滩中心30楼

办公地址：中国北京市东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层

法定代表人：谢英峰

联系电话：010-85207788

传真：010-85181218

联系人：吴蓉

经办注册会计师：郭新华、吴蓉

六、基金的募集

（一）基金的历史沿革

本基金由亚洲债券基金第二期中国子基金专户转开放而来。

亚洲债券基金第二期中国子基金经中国证监会《关于第二期亚洲债券基金中国子基金有关问题的函》（证监办函[2005]68号）认可，由华夏基金管理有限公司担任基金管理人，以接受特定对象财产委托从事证券投资活动的形式从事中国子基金投资管理。基金持有人为东亚及太平洋中央银行行长会议组织（Executives' Meeting of East Asia and Pacific Central Banks，简称“EMEAP”）。基金投资主要采用代表性分层抽样复制策略，跟踪 iBoxx[®]亚债中国指数。

经监管部门批准，亚洲债券基金第二期中国子基金由专户转为开放式基金公开募集，基金投资方向和投资策略与专户阶段完全相同。为节约基金建仓成本，EMEAP 将以专户资产（含现券和现金）换购为基金份额继续持有。

（二）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2011 年 3 月 14 日证监许可[2011]392 号文核准。

（三）基金类型和存续期间

- 1.基金的类型：债券基金。
- 2.基金的运作方式：契约型开放式。
- 3.基金存续期间：不定期。

（四）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见本基金发售公告）向投资者公开发售。

（五）募集期限

本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自2011年4月26日至2011年5月23日进行发售。如果在此期间未达到本招募说明书第七条第（一）款规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

（六）募集对象

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（七）募集场所

投资者应当在基金管理人、代销机构办理基金发售业务的营业场所或按基金管理人、代销机构提供的其他方式办理基金的认购。销售机构名单和联系方式具体见本基金发售公告。

基金管理人、代销机构办理基金发售业务的地区、网点的具体情况和联系方法，请参见本基金发售公告以及当地销售机构的公告。

基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

（八）基金份额类别

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，A类在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费，不收取销售服务费；C类不收取前后端认购/申购费，销售服务费年费率为0.4%。本基金A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据基金销售情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，增加新的基金份额类别、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售、或者向证券交易所申请基金份额的上市等，调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

（九）认购安排

1. 认购时间：2011年4月26日至2011年5月23日。具体业务办理时间以各销售机构的规定为准。

2. 认购程序：投资者在首次认购本基金时，需按销售机构的规定，提出开立华夏基金管理有限公司基金账户和销售机构交易账户的申请。一个投资者只能开立和使用一个基金账户，已经开立华夏基金管理有限公司基金账户的投资者可免于申请。

3. 认购原则：认购以金额申请。投资者认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项。投资者可以多次认购本基金份额，每次认购金额不得低于1,000元。认购申请受理后，投资者不得撤销。

4. 认购申请的确认：销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以登记结算机构的确认为准。投资者应在基金合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

投资者开户和认购所需提交的文件和办理的具体手续由基金管理人和销售机构约定，请投资者参阅本基金发售公告。

（十）认购费用

1. 投资者在认购A类基金份额时需交纳前端认购费，费率按认购金额递减，具体如下：

| 认购金额（含认购费） | 前端认购费率 |
|--------------------------|----------|
| 100万元以下 | 0.6% |
| 100万元以上（含100万元）-500万元以下 | 0.4% |
| 500万元以上（含500万元）-1000万元以下 | 0.2% |
| 1000万元以上（含1000万元） | 每笔1,000元 |

投资者如认购 C 类基金份额，则前端认购费为 0。

2.本基金认购费由认购人承担，认购费不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。

3.投资者重复认购时，需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。

（十一）募集资金利息的处理方式

认购款项在募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额（折算份额为投资者认购时选择的相应类别）归基金份额持有人所有，其中利息以登记结算机构的记录为准，利息折算份额不收取认购费。

（十二）认购份额的计算

本基金A类、C类基金份额的初始面值均为1.00元。

1.当投资者选择认购A类基金份额时，认购份额的计算方法如下：

（1）认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{前端认购费率})$$

$$\text{前端认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1.00 \text{ 元}$$

（2）认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{前端认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{前端认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1.00 \text{ 元}$$

2.当投资者选择认购C类基金份额时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{认购份额} = (\text{认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1.00 \text{ 元}$$

3.认购份额的计算按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例一：某投资者投资 1,000 元认购本基金 A 类基金份额，假设这 1,000 元在募集期间产生的利息为 0.46 元，则其可得到的基金份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 1,000 / (1 + 0.6\%) = 994.04 \text{ 元}$$

前端认购费用=1,000-994.04=5.96 元

认购份额= (994.04+0.46) /1.00=994.50 份

即投资者投资 1,000 元认购本基金 A 类基金份额,加上募集期间利息后一共可以得到 994.50 份 A 类基金份额。

例二:某投资者投资 1,000 元认购本基金 C 类基金份额,假设这 1,000 元在募集期间产生的利息为 0.46 元,则其可得到的基金份额计算如下:

认购份额= (1,000+0.46) /1.00=1,000.46 份

即投资者投资 1,000 元认购本基金 C 类基金份额,加上募集期间利息后一共可以得到 1,000.46 份 C 类基金份额。

(十三) 特殊投资者 EMEAP 的认购

EMEAP提供对本基金的初始投资,该部分投资已自2005年6月起以独立账户形式运作,目前资产规模约为21亿元人民币。为节约建仓成本,EMEAP初始投资组合将以现券和少量现金的形式直接认购为本基金A类基金份额。认购时间为发售期的最后一日,债券认购折算价格按照基金合同规定的估值方法确定。

EMEAP由下列亚太区的中央银行和金融当局组成:澳大利亚储备银行、中国人民银行、香港金融管理局、印度尼西亚央行、日本央行、韩国央行、马来西亚央行、新西兰储备银行、菲律宾央行、新加坡金融管理局和泰国央行。

EMEAP的中央银行和金融当局成员作为基金份额持有人,与其他基金份额持有人享有同等权利,可在基金开放后赎回或转换其持有的基金份额而且不需事先公告。

(十四) 募集期间的资金与费用

基金募集期间募集的资金和债券应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

七、基金合同的生效

(一) 基金备案条件

基金募集期限届满,具备下列条件的,基金管理人应当按照规定办理基金验资和备案手续:

1.基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额(含EMEAP初始投资)不少于2亿元人民币;

2.基金份额持有人的人数不少于200人。

(二) 基金的验资和备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同生效

自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

（四）基金募集失败

基金募集期限届满，未具备上述基金备案条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效的，则基金募集失败，基金合同不生效。

基金募集失败时，基金管理人应当以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并应在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

（五）基金合同生效后的基金份额持有人数量和资产规模

在基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

八、基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购和赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。投资者应当在销售机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1. 开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并提前公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回等业务。投

投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

2. 申购、赎回的开始时间

本基金在自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间内开放申购、赎回。

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 1 个工作日在至少一种指定媒体公告。

（三）申购和赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 本基金份额分为多个类别，适用不同的申购费、销售服务费，投资者在申购时可自行选择基金份额类别；

4. 投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准；

5. 当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

6. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 2 日在至少一种指定媒体公告。

（四）申购和赎回的数额限制

1. 投资者每次最低申购金额为 1,000 元（含申购费）。

2. 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 100 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购金额、赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整的 2 日前在至少一种指定媒体上公告。

（五）申购和赎回的程序

1. 申购和赎回申请的提出

投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，其在销售机构（网点）须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2. 申购和赎回申请的确认与通知

投资者 T 日申购基金成功后，登记结算机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。投资者 T 日赎回基金成功后，登记结算机构在 T+1 日为投资者办理扣减权益的登记手续。

T日规定时间受理的申请，正常情况下投资者应在T+2日后（包括该日）通过本公司网站、客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况，打印确认单。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。

3. 申购与赎回申请的款项支付

申购时，采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功的款项将退回投资者账户。

赎回时，当投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照基金合同、招募说明书和有关法律法规规定处理。

（六）申购费与赎回费

1. 对于A类基金份额，投资者在申购时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

| 申购金额（含申购费） | 前端申购费率 |
|------------------------------|----------|
| 100 万元以下 | 0.8% |
| 100 万元以上（含 100 万元）-500 万元以下 | 0.6% |
| 500 万元以上（含 500 万元）-1000 万元以下 | 0.4% |
| 1000万元以上（含1000万元） | 每笔1,000元 |

申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2. 本基金 C 类基金份额不收取申购费。

3. 本基金 A 类、C 类基金份额均收取赎回费，赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。赎回时份额持有不满 90 天的，收取 0.3% 的赎回费，持有满 90 天以上（含 90 天）的，赎回费为 0。其中，所收取赎回费总额不低于 25% 归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

4. 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前 1 个工作日在至少一种指定媒体公告。

5. 经中国证监会允许，基金管理人可以在遵守法律法规及基金合同规定的条件下，针对特定期间或符合特定条件的投资者，采取调低基金申购费、赎回费或调高基金赎回费等措施，基金管理人须于该等措施实施前至少 1 个工作日在至少一种指定媒体公告。

(七) 申购份额与赎回金额的计算方式

1. 申购份额的计算

(1) 当投资者选择申购A类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

① 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

② 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{前端申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

(2) 当投资者选择申购C类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T日C类基金份额净值}$$

(3) 基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例三：假定T日基金的A类基金份额净值为1.230元，若三笔申购金额分别为1,000元、100万元和500万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

| | 申购1 | 申购2 | 申购3 |
|-------------------|--------|------------|--------------|
| 申购金额 (元, a) | 1,000 | 1,000,000 | 5,000,000 |
| 适用前端申购费率 (b) | 0.8% | 0.6% | 0.4% |
| 净申购金额 (c=a/(1+b)) | 992.06 | 994,035.79 | 4,980,079.68 |
| 前端申购费 (d=a-c) | 7.94 | 5,964.21 | 19,920.32 |
| 该类基金份额净值 (e) | 1.230 | 1.230 | 1.230 |
| 申购份额 (f=c/e) | 806.55 | 808,159.18 | 4,048,845.27 |

若申购金额为1000万元，则申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

| | 申购4 |
|---------------|--------------|
| 申购金额 (元, a) | 10,000,000 |
| 前端申购费 (b) | 1,000 |
| 净申购金额 (c=a-b) | 9,999,000 |
| 该类基金份额净值 (d) | 1.230 |
| 申购份额 (e=c/d) | 8,129,268.29 |

例四：假定T日基金的C类基金份额净值为1.200元，申购金额为10万元，则申购获得的基金份额计算如下：

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.200 = 83,333.33 \text{份}$$

2. 赎回金额的计算

(1) 当投资者赎回A类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日A类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

(2) 当投资者赎回C类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日C类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

例五：假定某投资者在T日赎回10,000份A类基金份额，持有期限20天，该日A类基金份额净值为1.250元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.250 = 12,500.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500 \times 0.3\% = 37.50 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500 - 37.5 = 12,462.50 \text{元}$$

例六：假定某投资者在T日赎回10,000份C类基金份额，持有期限95天，该日C类基金份额净值为1.225元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.225 = 12,250.00 \text{元}$$

3.T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告。各个基金份额类别单独计算基金份额净值，计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

(八) 拒绝或暂停申购的情形

在发生下列情形时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1. 不可抗力导致基金无法接受申购；
2. 证券交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
4. 因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券即将上市或进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人利益的；
5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法顺利实施投资策略，可能对基金业绩产生负面影响，从而损害已有基金份额持有人的利益；
6. 个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；
7. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的；

8.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在发生下列情形时，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1.不可抗力导致基金无法支付赎回款项；
- 2.证券交易场所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3.发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- 4.基金连续2个开放日及以上发生巨额赎回；
- 5.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人在有能力兑付时，应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例受理赎回申请人的部分赎回申请，其余赎回申请则延期办理，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。赎回申请的延期办理最迟不得超过正常支付时间 20 个工作日。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

（十）巨额赎回的认定及处理方式

1.巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。

2.巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，

应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

当发生巨额赎回并部分延期办理时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在2日内通过至少一种指定媒体刊登公告，说明有关处理方法。

本基金连续2个开放日以上（含2个开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在至少一种指定媒体公告。

（十一）申购和赎回暂停期间与重新开放的公告

暂停申购或暂停赎回结束、基金重新开放时，基金管理人应在至少一种指定媒体公告：

1.如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金份额净值。

2.如果发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应至少提前1个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

3.如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应至少提前2日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

（十二）基金的转换

基金管理人可与销售机构协商，为投资者提供基金转换的服务，即投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开办基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。其中，基金转出视同赎回，需遵守转出基金有关赎回业务的各项规定，并缴纳赎回费用；基金转入视同申购，需遵守转入基金有关申购业务的各项规定。基金管理人或销售机构可以就基金转换业务收取一定的手续费。有关基金转换业务的具体规则由基金管理人制定并另行公告。

九、基金的转托管与非交易过户等其他业务

（一）登记结算机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情况下的非交易过户申请。其中继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金份额持有人

将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理并按登记结算机构规定的标准收费。登记结算机构可依据其业务规则受理其他情况下的非交易过户申请，或委托销售机构代为办理。

（二）基金份额持有人在变更办理基金申购、赎回等业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在原销售机构（网点）办理转托管转出手续后 20 个工作日内到新选择的销售机构（网点）办理转托管转入手续。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在办理转托管转入手续后转入其指定的销售机构（网点）。投资者需按销售机构（网点）的规定交纳一定的手续费。

（三）登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照有关规定来决定是否冻结。

（四）根据相关法律法规的规定，登记结算机构可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

十、基金的投资

（一）投资目标

本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于非成份券，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但是这些金融工具限于以人民币计价的债券、货币市场金融产品、现金或类似现金的产品。本基金不得投资于股票。

（三）投资策略

本基金为被动管理基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。

1. 债券指数化投资

（1）组合构建策略

构建投资组合的过程主要分为 3 步：指数成份券流动性筛选、确定目标组合和逐步调整建仓。

①指数成份券流动性筛选：通过日均交易量、报价次数、买卖价差和是否为跨市场债券等定量和定性指标，筛选具有较好流动性的指数成份券作为组合备选券。

②确定目标组合：使用代表性分层抽样法确定各备选券权重，使组合总体特征与指数相似。

③逐步调整建仓：根据市场实际流动性情况和投资机会，进一步调整和优化组合并逐步建仓。

在一般情况下，本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金将在基金合同生效之日起 6 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份券调整、基金申购或赎回带来资金流动等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

（2）月度组合管理

①根据标的指数月度调整，对组合持有的债券及其权重进行调整，保证组合总体特征与调整后的标的指数相似。

②根据基金费用、收益分配等支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

③在公司研究团队月度策略会议上对组合操作及跟踪误差等进行分析，分析最近组合与标的指数总回报的差异情况，找出相应原因。

④公司投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

（3）跟踪误差目标

在正常市场情况下，本基金追求债券指数化投资组合在扣除基金费用前的总回报与标的指数总回报之间的年化跟踪误差不超过 50 个基点（一个基点为万分之一）。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

2. 衍生品投资

未来，如法律法规或监管机构允许基金投资衍生品的，经持有人大会同意后，基金可以参与相关衍生品投资。基金衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征，以便更好地实现基金的投资目标。基金将主要投资于与利率、标的指数、标的指数成份券或构成基金组合的其他非成份券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等。基金持有金融衍生工具风险敞口的绝对总额不得超过基金资产的 10%。基金的衍生品投资只能用于风险对冲而不能用于投机。

3. 未来，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在依法履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，并更新和丰富基金投资策略。

（四）投资管理体制

公司实行投资决策委员会领导下的投资总监负责制。投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；投资总监全面负责公司的投资、研究、交易工作，向投资决策委员会报告；基金经理负责所管理基金的日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

（五）投资管理程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1.研究

公司研究团队整合外部信息开展指数跟踪分析、流动性分析、跟踪误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

2.投资决策

投资决策委员会依据公司研究团队提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

3.组合构建

根据标的指数，结合研究报告，基金经理主要以代表性分层抽样复制法构建组合。在保证组合总体特征与标的指数相似的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低交易成本、控制投资风险。

4.交易执行

交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

5.风险与绩效评估

基金定期和不定期地进行风险和绩效评估。风险评估使得投资决策委员会和基金经理能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略。绩效评估能够确认组合是否实现了投资目标、组合跟踪误差的来源及投资策略是否成功，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

6.组合监控与调整

基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份券流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合风险和投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为 Markit 指数公司（Markit Indices Limited）编制并发布的 iBoxx^{®1}亚债中国指数。iBoxx[®]亚债中国指数成份券包括政府发行的以及由政府提供信用支持的机构发行的人民币债券，例如国债、央行票据、政策性金融债和地方政府债券等。

若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的变更（包括但不限于编制机构变更），则应经过基金份额持有人大会同意，并报中国证监会核准或者备案。

（七）风险收益特征

本基金属于债券基金，风险与收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于政府债券，风险和收益低于投资范围包括股票、可转换公司债及普通企业债的债券基金。

（八）禁止行为

- 1.向他人贷款或者提供担保；
- 2.从事承担无限责任的投资；
- 3.买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 4.向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 5.买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他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；
- 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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如果法律法规或监管机构对基金合同约定的禁止行为进行变更的，本基金可相应调整禁止行为规定，不需经基金份额持有人大会审议。

（九）投资限制

- 1.基金不得投资于非标的指数成份券发行人发行的债券；
- 2.基金投资于非标的指数成份券的比例不得超过基金资产净值的 30%；
- 3.基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例不得低于基金资产净值的 5%；
- 4.基金不得从事卖空；
- 5.法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他限制。

基金管理人应当在基金合同生效后的6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，使本基金重新符合上述规定。

¹ iBoxx 是 Markit 指数公司（Markit Indices Limited）的注册商标。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个交易日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从10个交易日延长到3个月。法律法规如有变更，则从其变更。

（十）基金的短期融资和证券出借

本基金可以按照法律法规或监管机构的有关规定进行短期融资和证券出借。管理人需在从事该项业务前征得持有人大会同意，具体风险管理方案亦需经持有人大会同意。基金进行债券回购投资不受本款限制。

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金需按有关规定开立基金资金账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。如相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人可依据新规定执行。

（四）基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
2. 基金投资或运作取得的财产和收益，归入基金财产。
3. 基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
4. 基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。
5. 除《基金法》等相关法律法规及基金合同另有规定，基金资产不得被处分。

十二、基金资产的估值

（一）估值日

基金合同生效后，每开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日对基金资产进行估值。

（二）估值方法

1.在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2.在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3.首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4.在银行间债券市场交易的债券，按公允价值估值。

5.在任何情况下，基金管理人如采用本款第1—4项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第1—4项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6.其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

7.法律法规或监管机构有最新规定的，按其规定进行估值。

（三）估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

（四）估值程序与基金净值的确认

基金的日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果报送基金托管人，基金托管人按照基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后将复核结果返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。

（五）估值错误的处理

1.基金份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

2.基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当计价错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应报告中国证监会；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

3.因基金份额净值计价错误而给投资者造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任。赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失。基金管理人在赔偿基金投资者后，有权向有关责任方追偿。基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利。

4.前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（六）暂停估值的情形

1.基金投资涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时；

2.因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

4.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5.中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（七）特殊情形的处理

1.基金管理人按本条第（二）款第5项规定进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十三、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

1.基金收益包括：基金投资所得债券利息、买卖证券差价、存款利息收入以及其他收入。

2.因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润为截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

1.由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。

2.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3.在符合上述基金分红条件的前提下，本基金方可进行收益分配。本基金每年度收益分配不超过4次，每次分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。若自基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配。

4.基金份额持有人可以选择取得现金红利或将所获红利再投资于本基金，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式，选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金按分红权益再投资日（具体以届时的分红公告为准）该类别的基金份额净值转成相应的基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。

5.法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并及时公告。基金收益分配方案须载明基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

（五）收益分配中发生的费用

1.收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付登记结算手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或其他公告中列示。

2.收益分配时发生的银行转账等手续费用应由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，登记结算机构可将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的分红公告为准）该类别的基金份额净值转为相应的基金

份额。

十四、基金的费用与税收

（一）基金运作费用

1.基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- （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）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后的会计师费、律师费和信息披露费用；
- （7）基金的资金汇划费用；
- （8）其他按照法律法规或监管机构规定可以从基金财产中列支的费用。

2.基金费用的费率、计提方式与支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.28%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

其中，基金管理费中包括基金管理人代 Markit 指数公司收取的 iBoxx[®]亚债中国指数的授权使用许可费。指数许可费按基金资产净值的比例收取，年费率最高为 0.023%，费率随基金规模、人民币汇率调整等因素变化而变化；而且，因支付指数许可费而发生的汇兑费用、转账费用以及 Markit 指数公司在国内应缴纳的相关税负等均由基金管理人代其支付。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

（3）销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类不收取销售服务费，C类销售服务费年费率为0.4%。

各类别基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H为各类别基金份额每日应计提的销售服务费

E为各类别基金份额前一日基金资产净值

R为各类别基金份额适用的销售服务费率

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中划出，经登记结算机构分别支付给各个基金销售机构。

（4）基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。但调高基金管理费和基金托管费的提议须首先经过基金份额持有人大会批准。

（5）本条第（一）款第1项中第（4）至第（8）项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付。

3.不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

（二）基金销售费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“（十）认购费用”以及“（十二）认购份额的计算”中的相关规定。

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（六）申购费与赎回费”与“（七）申购份额与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

（三）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1.基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2.基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3.会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4.本基金独立建账、独立核算。
- 5.本基金会计责任人为基金管理人。
- 6.基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。

（二）基金审计

- 1.基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。
- 2.会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3.基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。

十六、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其实施准则、基金合同、本招募说明书及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项将按照有关规定，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体（包括报刊和网站）公告。

（一）基金合同、托管协议、招募说明书、基金份额发售公告

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

（二）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（三）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少1个工作日在指定报刊及网站上公告。

（四）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、代销机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（五）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照相关规定编制，由基金托管人复核。基金定期报告包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

1. 季度报告：基金季度报告在每季度结束后的15个工作日内编制完成，并登载在指定报刊和网站上。

2. 半年度报告：基金半年度报告在基金会计年度前6个月结束后的60日内编制完成，半年度报告正文登载在网站上，半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3. 年度报告：基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的90日内编制完成，年度报告正文登载于网站上，年度报告摘要登载在指定报刊上。

4. 基金合同生效不足2个月的，可不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5. 法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（六）临时报告与公告

基金在运作过程中发生下列可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事项时，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；

- 2.终止基金合同;
- 3.转换基金的运作方式;
- 4.更换基金管理人、基金托管人;
- 5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6.基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7.基金募集期延长;
- 8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9.基金管理人的董事在一年内变更超过50%;
- 10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%;
- 11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;
- 12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14.重大关联交易事项;
- 15.基金收益分配事项;
- 16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 17.基金份额净值计价错误达基金份额净值的0.5%;
- 18.基金改聘会计师事务所;
- 19.基金变更、增加或减少代销机构;
- 20.基金更换登记结算机构;
- 21.基金开始办理申购、赎回;
- 22.基金申购费率、赎回费率、销售服务费率或收费方式发生变更;
- 23.基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24.基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25.基金暂停办理申购、赎回;
- 26.基金重新开始办理申购、赎回;
- 27.基金变更标的指数;
- 28.基金推出新业务或服务;
- 29.中国证监会规定的其他事项。

（七）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书、基金份额发售公告、基金合同生效公告、定期报告、临时公告等文本存放在基金管理人和基金托管人的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者也可在基金管理人网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

十七、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日的基金的净赎回与净转出申请之和超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资者应当认真阅读本基金“基金合同”、“招募说明书”等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金的招募说明书以及相关公告。

本基金在认购期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元，从而遭受损失的风险。

（一）投资于本基金的主要风险

1.投资组合风险

(1) 利率风险：利率上升时，基金持有的固定收益证券组合的价值将随之下降。本基金跟踪标的指数，不进行积极管理，在债券市场下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

(2) 收益风险：利率下降时，基金再投资收益和利息收入将下降，基金分红可能随之减少。

(3) 市场风险：基金份额净值将受证券市场波动所影响，投资者可能因债券市场波动承担短期或长期损失。

(4) 资产类别风险：基金主要投资于以人民币计价的国债、央行票据和政策性金融债等，这些资产类别的回报可能高于或低于市场平均水平。

2.跟踪误差风险

以下因素可能导致基金债券投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

(1) 基金采用代表性分层抽样复制策略，基金投资组合与标的指数构成可能存在差异。在抽样复制过程中，为流动性考虑，基金将可能主要投资于跨市场债券。

(2) 基金有投资成本和各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收。

(3) 债券利息在指数编制中计算再投资收益，而基金在再投资中未必能获得相同的收益率。

(4) 当指数调整成份券构成时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本。

(5) 投资者申购、赎回将带来一定的现金流或变现需求，在债券市场流动性不足时，或受银行间债券市场债券交易起点的限制，基金组合将存在现金拖累，或在变现中遭遇一定的变现损失。

(6) 其他因素产生的偏离，如基金估值与指数成份券定价的差异、指数供应商的指数编制错误等。

3.流动性风险

在市场流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

4.标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的

标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

5.操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记结算机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

6.其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

(二) 声明

1.本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2.除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但是，本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

3.EMEAP将投资于本基金。但本基金并非由任何EMEAP的中央银行和金融当局成员推广、发起、推荐、发行或保证。EMEAP的中央银行和金融当局成员作为基金份额持有人，与其他基金份额持有人享有同等权利，可在基金开放后赎回或转换其持有的基金份额而且不需事先公告。

4.iBoxx[®]是Markit指数公司（简称“Markit”）的注册商标，基金管理人已经获得许可使用该商标，但Markit并未同意、认可或推荐基金管理人或本基金。

本基金的投资是基于 Markit 提供的 iBoxx[®]亚债中国指数进行的，该指数是基于被认为是可靠的资料来源建立的，但 Markit 及其雇员、供应商、分包人及代理人（统称为“Markit 关联人”）不保证本基金或与基金相关的其他信息的真实性、完整性或准确性。对于基金或基金包含的数据、或者与基金有关的任何人员或机构对基金或其数据的使用，Markit 或任何 Markit 关联人不就其状态、质量满意、业绩表现、或者适用性提供或承担任何声明、保证或者条件（不管是明示的或是暗示的、法定的或是其他的），这些声明、保证或者条件是被排除的，除非该排除被法律禁止。

十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。但如属于基金合同第九条第（一）款第2项规定的不需召开基金份额持有人大会的情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情况。

发生上述情形之一的，基金管理人应及时公告，并按法律法规和基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果核准并予以公告之日起，基金合同终止。

（三）基金财产的清算

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

1. 基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（1）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（2）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2. 基金财产清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）基金清算组做出清算报告；
- （6）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；

- (7) 公布基金财产清算公告；
- (8) 对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

4.基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳基金所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做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，并在2个工作日内公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

十九、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

二十、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

二十一、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和代销机构提供。

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

- (一) 资料寄送

1.基金交易对账单

基金管理人向账单期内发生交易、或账单期末仍持有本公司基金份额的基金份额持有人以书面或电子形式定期或不定期寄送对账单，但由于基金份额持有人未详实填写或更新客户资料（含姓名、地址等）导致基金管理人无法寄送，或基金份额持有人主动取消寄送的除外。

2.其他相关的信息资料

指随基金交易对账单不定期寄送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、开放式基金运作情况回顾、客户服务问答等。

（二）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记结算机构将其所获红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额（具体以届时的基金分红公告为准）。红利再投资免收申购费用。

（三）定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务，即投资者可通过固定的销售机构，采用定期定额的方式申购基金份额，定期定额投资不受日常最低申购金额限制。定期定额具体实施时间和业务规则详见我公司发布在指定信息披露媒体及公司网站公告。

（四）基金转换

投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开通基金转换业务的销售机构办理基金转换业务。基金转换需遵守转入基金、转出基金有关基金申购赎回的业务规则。办理基金转换业务的投资者可获得一定的费率优惠，具体业务规则和办理时间详见我公司发布在指定信息披露媒体及公司网站公告。

（五）网上交易

持有中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡、中国工商银行借记卡、招商银行储蓄卡、交通银行太平洋借记卡、兴业银行股份有限公司兴业借记卡、民生银行借记卡、浦发银行东方卡/活期账户一本通、广东发展银行借记卡（理财通卡）等银行卡的个人投资者，开通天天盈账户的个人投资者，以及在华夏基金投资理财中心开户的个人投资者，在登录本公司网站（www.ChinaAMC.com），与本公司达成网上交易的相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可办理基金账户开立、基金认购、申购、赎回、转换、资料变更、分红方式变更、信息查询等各项业务。有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站查询。本基金具体业务办理情况请参见本公司发布的相关公告。

（六）电子邮件服务

投资者在申请开立本公司基金账户时如预留电子邮件地址并通过本公司网站订制电子邮件服务，可自动获得相应服务。未预留相关资料的投资者可办理资料变更后获得此项服务。

（七）呼叫中心

1.自动语音服务

提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务，客户可通过电话查询最新公告信息、基金份额净值、基金账户余额等信息。

2.人工电话服务

提供每周七天的人工服务。周一至周五的人工电话服务时间为 8：30~21：00，周六至周日的人工电话服务时间为 8：30~17：00（法定节假日除外）。

客户服务电话：400-818-6666

客户服务传真：010-63136700

（八）在线服务

通过本公司网站，投资者可获得如下服务：

1.查询服务

投资者可登录本公司网站“基金账户查询”，查询基金账户情况、更改个人信息、订制个性化服务。

2.在线客服服务

投资者可点击本公司网站“在线客服”，进行咨询或留言。在线客服的人工服务时间为8：30~17：00（法定节假日除外）。

3.资讯服务

投资者可通过本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

公司网址：www.ChinaAMC.com

电子信箱：service@ChinaAMC.com

（九）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心语音留言、呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

二十二、其他应披露事项

（一）选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准和程序

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用，选择标准为：

1. 资历雄厚，信誉良好。
2. 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
3. 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
4. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务。研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能
及时、定期、全面地为本基金提供相关信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究
报告。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订书面协议。

（二）席位租用期限及更换方式

席位的使用期限暂定为半年。使用期满后，基金管理人将根据各证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，包括：

1. 提供的研究报告质量和数量；
2. 研究报告被基金采纳的情况；
3. 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
4. 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
5. 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
6. 开放证券经营机构资料库的情况；
7. 其他可评价的量化标准。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易席位。

（三）席位运作方式

基金管理人将结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量,分配基金在各席位买卖证券的交易量。

(四) 其他事宜

基金管理人将根据有关规定,在基金半年度报告和年度报告中将所选择的证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露,并向中国证监会报告。

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1.中国证监会核准亚债中国债券指数基金募集的文件
- 2.《亚债中国债券指数基金基金合同》
- 3.《亚债中国债券指数基金托管协议》
- 4.法律意见书
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人或基金托管人处。

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后,可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一一年四月十九日

附件一 基金合同摘要

一、基金合同当事人及其权利义务

(一) 基金管理人

1. 基本情况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层

法定代表人：范勇宏

成立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元

存续期间：100 年

2. 基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 运用基金财产；
- (3) 获得管理人报酬；
- (4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (5) 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、转托管、转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (6) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
- (7) 在符合法律法规和基金合同规定的前提下销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回费及其它法律法规规定的费用；
- (8) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护本基金及相关当事人的利益；
- (9) 在基金托管人更换时，提名新任基金托管人；

(10) 选择、更换代销机构，并依据代销协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(11) 自行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算代理机构，办理基金登记结算业务，并按照基金合同规定对基金登记结算代理机构进行必要的监督和检查；

(12) 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；

(13) 在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行短期融资、证券出借；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

(15) 依据有关法律法规以及基金合同召集基金份额持有人大会；

(16) 以基金管理人的名义，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；

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

(18) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其它权利。

3.基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、勤勉尽责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和受托资产分别管理、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，不得为自己及任何第三人谋取非法利益，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) 按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 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；

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

- (12) 编制中期和年度基金报告;
- (13) 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;
- (14) 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,应予以保密,不得向他人泄露;
- (15) 按基金合同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;
- (16) 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;
- (17) 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;
- (18) 以基金管理人的名义,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;
- (19) 组织并参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20) 因违反《基金法》或基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
- (21) 基金托管人违反《基金法》或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托管人追偿;
- (22) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

(二) 基金托管人

1.基金托管人基本情况

名称: 交通银行股份有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 胡怀邦

成立日期: 1987 年 3 月 30 日

基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[1998]25 号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 562.59 亿元人民币

存续期间: 持续经营

2.基金托管人的权利

- (1) 获得基金托管费;
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作;
- (3) 自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;
- (4) 在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

- (5) 依法召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其它权利。

3.基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (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；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以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) 按规定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；
- (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应予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、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；
- (9) 根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；
- (10) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- (11) 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；
- (12) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额累计净值及基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (15) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (16) 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、基金转换转出款项；

(17) 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;

(18) 因违反《基金法》或基金合同导致基金财产的损失, 应承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除;

(19) 基金管理人因违反《基金法》或基金合同造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金向基金管理人追偿;

(20) 参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(21) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

基金投资者自依据基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和基金合同的当事人, 其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受, 基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

1. 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) 依据有关法律法规以及基金合同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) 获得基金管理人和基金托管人关于基金管理运作的相关报告, 包括但不限于基金申购赎回政策、法律法规变化对基金运作的影响;

(9) 对基金管理人、基金托管人、登记结算机构、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(10) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其它权利。

2. 基金份额持有人的义务

(1) 遵守法律法规、基金合同、业务规则以及其他有关规定;

(2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用;

(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) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动，为避免疑义，持有人根据上述第 1 款规定行使权利的行为不应被视为是导致基金或其他基金份额持有人合法权益受损的行为；

(5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、基金管理人的代理人及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

(7) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

(一) 召开事由

1. 有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 变更基金类别；
- (2) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (3) 变更基金份额持有人大会程序；
- (4) 终止基金合同；
- (5) 转换基金运作方式；
- (6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (7) 更换基金管理人、基金托管人，但基金合同另有约定的除外；
- (8) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 以下情况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资产承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的基金份额类别设置或调整各类别基金份额的申购费率、赎回费率、销售服务费率或收费方式；

(3) 经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、登记结算机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(4) 当基金管理人或基金托管人发生股权变动、机构合并/分立、变更经营范围、变更公司形式或公司名称等事项，但其基金管理或托管业务未发生实质性变动，对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不召开持有人大会；

(5) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务，如电话交易；

(6) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(7) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

- (8) 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；
- (9) 除法律法规或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

1. 在正常情况下，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者不能召集时，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。

3. 代表基金份额 10% 以上（除特别说明，“以上”含本数，下同）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。基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，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。

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知方式、通知内容

1. 通知时间和通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在至少一种指定媒体公告通知。

2. 通知内容

基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (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) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 召集人需要通知的其他事项。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议

通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式。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

召集人可选择以现场开会或通讯开会方式召开基金份额持有人大会。

1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，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。

现场开会方式在同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上。

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保持不变。

2.通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按本基金合同规定公布会议通知后，连续公布相关提示性公告；

（2）大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同地称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

（3）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基金份额持有人的书面表决意见；

（4）所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额占本基金权益登记日基金总份额的 50%以上；

（5）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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

采取通讯方式进行表决时，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弃权表决，但应当计入出具有效书面意见的基金份额持

有人所代表的基金份额总数。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，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保持不变。

（五）议事内容与程序

1. 议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如本条第（一）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。

2. 议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，大会主持人由召集人指定。大会主持人应按照下列第（六）款规定程序确定监票人，然后宣读提案，经基金份额持有人讨论后进行表决，形成大会决议。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天统计全部有效表决，在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，不影响基金份额持有人大会决议的效力。

（六）决议形成的条件、表决方式、程序

1. 决议形成的条件

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上多数（不含 50%）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）特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人或者更换基金托管人（基金合同另有约定的除外）、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议方式通过。

2. 表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。每一基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

3.表决程序

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。

计票程序如下：

(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推举两名基金份额持有人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两名基金份额持有人代表与基金管理人授权的一名监督员共同担任监票人，如果基金管理人未授权代表出席，则由基金托管人授权的一名监督员与选举出的两名基金份额持有人代表共同担任监票人；但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举 3 名基金份额持有人代表担任监票人，不影响表决效力。

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议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

由大会召集人授权的两名监督员在监督人派出的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。如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证，不影响表决效力。

(七) 基金份额持有人大会决议的生效与公告

基金份额持有人大会通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一种指定媒体公告。

生效的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、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(八) 法律法规或监管机构对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金合同的终止

(一) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1.基金份额持有人大会决定终止；
- 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、基金托管人承接的；
- 3.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应及时公告，并按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果核准并予以公告之日起，本基金合同终止。

（二）基金财产的清算

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

1.基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（1）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（2）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2.清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）基金清算组做出清算报告；
- （6）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；
- （7）公布基金财产清算公告；
- （8）对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

4.基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- （1）支付清算费用；

- (2) 交纳基金所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算组做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,并在2个工作日内公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

四、争议的处理

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

本基金合同的当事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或调解解决。协商或者调解不能解决的,任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为上海市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效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。

除争议所涉内容之外,本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所。投资者可登录基金管理人和基金托管人网站查询。投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但内容应以本基金合同正本为准。

附件二 基金托管协议摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：华夏基金管理有限公司
住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层
邮政编码：100033
法定代表人：范勇宏
成立时间：1998 年 4 月 9 日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文
注册资本：23800 万元
组织形式：有限责任公司
存续期间：100 年

（二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
住所：上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码：200336
法定代表人：胡怀邦
成立时间：1987 年 3 月 30 日
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号
注册资本：562.59 亿元人民币
组织形式：股份有限公司
存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金主要投资于标的指数成份券。为了更好地实现投资目标，基金还可以投资于非成份券，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但是这些金融工具限于以人民币计价的债券、货币市场金融产品、现金或类似现金的产品。本基金不得投资于股票。

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，基金管理人运用基金财产进行证券投资，不得有下列情形：

1. 投资于非标的指数成份券发行人发行的债券；
2. 投资于非标的指数成份券的比例超过基金资产净值的 30%；
3. 现金以及到期日在 1 年以内的政府债券的比例低于基金资产净值的 5%；
4. 从事卖空交易；
5. 违反基金合同关于投资范围和投资策略等的约定；
6. 中国证监会规定禁止的其他情形。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。法律法规如有变更，则从其变更。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

1. 向他人贷款或者提供担保；
2. 从事承担无限责任的投资；
3. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
4. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
5. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他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；

- 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，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如果法律法规或监管机构对基金合同约定的禁止行为进行变更的，本基金可相应调整禁止行为规定，不需经基金份额持有人大会审议。根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后2个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日起生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

2.基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1.基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2.基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3.基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资

料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4.基金管理人应与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

（六）基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

（七）基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等行为进行监督和核查。

（八）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本托管协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并通知基金管理人在收到通知后及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（九）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、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，同时立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

三、基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本托管协议规定，基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否及时开立基金财产的资金账户/证券账户和债券托管账户、是否准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、如遇到问题是否及时反馈，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为、是否对非公开信息保密。

基金管理人定期或不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1.基金托管人应安全、完整保管基金财产。
- 2.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 3.基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。
- 5.基金托管人未经基金管理人的授权，不得擅自运用、处分、分配基金的任何财产。
- 6.除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

对于因为基金投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金财产，基金托管人仅限于保管资产的行使依据及有关记录，由于该机构破产、疏忽、欺诈、故意不当以及其他违约行为给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

（二）募集资产的验资

基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金募集的证券过户至基金托管人为基金开立的证券账户下，基金托管人在收到资金及收妥证券当日出具相关证明文件。

（三）基金的银行存款账户的开立和管理

1.基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2.基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回款项、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行存款账户进行。

3.本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用本基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

4.基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5.基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

6.基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户，及时核查基金银行存款账户余额。

（四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

1.基金托管人应当代表本基金以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

2.基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金管理人不得对本基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

4.基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部托管资产在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5.基金托管人以本基金的名义在基金托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

（五）债券托管账户的开立和管理

1.基金合同生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立银行间债券市场债券托管账户，并由基金托管人负责本基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。

2.基金管理人和基金托管人共同代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

（六）基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

（七）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表本基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本托管协议另有规定外，基金管理人在代本基金签署与本基金有关的重大合同时应尽可能保证持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得两份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别，各基

基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值；基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

基金管理人应每估值日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日计算当日的基金份额净值，盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人将基金份额净值予以公布。双方采用电子对账方式进行估值结果的核对。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人可委托基金登记结算机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记结算机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册：

1.基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册；

2.基金管理人于基金份额持有人大会权利登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册；

3.基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册；

4.除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人协商一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记结算机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年，如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方

当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在上海,仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。

争议处理期间,相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本托管协议受中华人民共和国法律管辖。

八、托管协议的修改与终止

(一) 基金托管协议的变更

本托管协议相关各方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应报中国证监会核准。

(二) 基金托管协议终止的情形

- 1.《基金合同》终止;
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产,被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产;
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产,被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。
- 4.发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。