

新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF） 上市交易公告书

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2017年2月24日

公告时间：2017年2月21日

目 录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览	4
三、基金的历史沿革、日常申赎、上市交易和转托管	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况	8
五、基金主要当事人简介	10
六、基金合同摘要	18
七、基金财务状况	49
八、基金投资组合	51
九、重大事件揭示	56
十一、基金托管人承诺	58
十二、备查文件目录	59

一、重要声明与提示

新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）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〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本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。

本基金托管人保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2013 年 12 月 23 日登载在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.ncfund.com.cn）上的《新华惠鑫分级债券型证券投资基金招募说明书》及其更新。

二、基金概览

(一) 基金名称：新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）

(二) 基金类型：债券型证券投资基金

(三) 基金运作方式：契约型，上市开放式基金（LOF）

(四) 基金存续期：不定期

(五) 基金份额总额：截止 2017 年 2 月 17 日，本基金份额总额 331,990,614.61 份

(六) 基金份额净值：截止 2017 年 2 月 17 日，本基金的基金份额净值 1.0007 元

(七) 本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：基金简称：新华惠鑫；基金代码：164302

(八) 本次上市交易的基金份额总额：截止 2017 年 2 月 17 日，本次上市交易份额为 59,780,963.00 份

(九) 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

(十) 上市交易日期：2017 年 2 月 24 日

(十一) 基金管理人：新华基金管理股份有限公司

(十二) 基金托管人：中国工商银行股份有限公司

(十三) 本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的历史沿革、日常申赎、上市交易和转托管

（一）本基金的历史沿革

新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由新华惠鑫分级债券型证券投资基金分级运作期届满转换而来。

新华惠鑫分级债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1320号核准募集。新华惠鑫分级债券型证券投资基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。基金管理人于2014年1月24日获得中国证监会书面确认，《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模为726,085,320.66份。

根据《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）”。惠鑫A、惠鑫B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额。本基金管理人于2017年1月10日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上刊登了《新华惠鑫分级债券型证券投资基金三年期届满与基金份额转型的公告》。本基金管理人于2017年1月24日对新华惠鑫分级债券型证券投资基金进行了3年分级届满后的转换工作。份额转换结果如下表：

转换前的基金份额	转换前的基金份额净值(元)	转换前基金份额数量(份)	转换比例	转换后基金份额	转换后基金份额数量(份)
惠鑫 A	1.016	9,908,494.15	1.015797260	新华惠鑫(场外)	10,065,021.20
惠鑫 B(场外)	1.796	253,537,796.05	1.796353477	新华惠鑫(场外)	455,443,501.48
转换后基金份额合计(场外)					465,508,522.68
转换前的基金份额	转换前的基金份额净值(元)	转换前基金份额数量(份)	转换比例	转换后基金份额	转换后基金份额数量(份)
惠鑫 B(场内)	1.796	42,522,859.00	1.796353477	新华惠鑫(场内)	76,386,085.00

本基金管理人已根据合同约定，对惠鑫 A、惠鑫 B 的份额持有人的基金份额进行了计算，并已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。本基金管理人于 2017 年 1 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、本基金管理人网站及深圳证券交易所网站发布了《新华基金管理股份有限公司关于新华惠鑫分级债券型证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果的公告》。

(三) 本基金的日常申购、赎回

本基金管理人于 2017 年 2 月 8 日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

(四) 新华惠鑫上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2017】126 号

2、上市交易日期：2017年2月24日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、本次上市的基金份额场内简称：新华惠鑫

5、本次上市的基金份额交易代码：164302

6、本次上市交易份额：59,780,963.00份（截止2017年2月17日）

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

8、基金资产净值的披露：基金管理人每日对基金资产估值。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。基金管理人于每个开放日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额参考净值传送给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。根据《证券投资基金法》，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。

（五）本基金转托管的主要内容

基金份额持有人自2017年1月23日起可以开始办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）持有人户数

截至 2017 年 2 月 17 日，新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF) 基金份额持有人总户数为：1431 户，场内基金份额持有人户数：152 户；场外基金份额持有人户数：1279 户；平均每户持有的场内基金份额：393,295.81 份；平均每户持有的场外基金份额：212,830.06 份

（二）基金份额持有人结构

截至 2017 年 2 月 17 日，机构投资者持有新华惠鑫场内基金份额为 49,795,252.00 份，占场内基金总份额比例为 83.30%；个人投资者持有新华惠鑫场内基金份额为 9,985,711.00 份，占场内基金总份额为 16.70%。

机构投资者持有新华惠鑫场外基金份额为 261,324,317.93 份，占场外基金总份额比例为 96.00%；个人投资者持有新华惠鑫场外基金份额为 10,885,333.68 份，占场外基金总份额比例为 4.00%。

截至 2017 年 2 月 17 日，前十名场内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	占场内基金份额的比例
1	长江养老保险股份有限公司—长江安稳延付 2 号投资账户	10,059,579.00	16.83%
2	包头钢铁（集团）有限责任公司企业年金计划—中国建设银行	5,389,060.00	9.01%

	行股份		
3	平安大华基金—平安银行—平安大华固定收益增强七号特定客户资	4,987,575.00	8.34%
4	平安大华基金—平安银行—平安大华固定收益增强六号特定客户资	4,701,955.00	7.87%
5	长江养老保险股份有限公司—长江安稳回报投资账户	4,641,777.00	7.76%
6	光大资管—光大—光大阳光稳健收益集合资产管理计划	3,296,783.00	5.51%
7	瑞泰人寿保险有限公司-万能	3,233,982.00	5.41%
8	中国烟草总公司江苏省公司企业年金计划—上海浦东发展银行股份有限公司股份	1,796,353.00	3.00%
9	四川成渝高速公路股份有限公司企业年金计划—招商银行	1,780,903.00	2.98%
10	太平养老金溢丰债券型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	1,480,375.00	2.48%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况

名称：新华基金管理股份有限公司

住所：重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

办公地址：北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

法定代表人：陈重

成立日期：2004年12月9日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】197号

注册资本：贰亿壹仟柒佰伍拾万元人民币

股权结构：

股东名称	出资额（万元人民币）	出资比例
恒泰证券股份有限公司	12,750	58.62%
新华信托股份有限公司	7,680	35.31%
杭州永原网络科技有限公司	1,320	6.07%
合计	21,750	100%

2、内部组织结构及职能

公司设立了投资管理委员会、专户投资管理委员会和风险管理委员会等专业委员会。

投资管理委员会是公司旗下证券投资基金资产运作的决策机构，总经理担任主任委员，其他委员由总经理指定人员担任。根据《基金法》、《基金合同》、《证券投资基金运作管理办法》等的规定，审议、决定基金经理提出的投资策略和投资方案，定期对基金经理的业绩进行评价；审核并决定基金产品方案；对基金资产运作所涉及的重大投资进行决策。

专户投资管理委员会是公司特定客户资产管理业务资产运作的决策机构，由总经理办公会研究决定其主任委员及其他成员。根据《基金法》、《资产管理合同》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等的规定，审议、决定专户投资经理提出的投资策略和投资方案，定期对专户投资经理的业绩进行评价，对专户管理所涉及的重大投资进行决策。

风险管理委员会负责确保公司内部控制制度的有效执行及投资风险严格控制，定期或不定期对公司内部风险控制制度的有效执行进行评估，对公司经营、投资中的风险进行研究、分析，并提出改进意见。

公司设权益投资部、固定收益与平衡投资部、研究部、专户管理部、交易部、市场营销部、产品开发部、基金投资部、运作保障部、计划财务部、人力资源部、监察稽核部、北京分公司、机构业务部、

电子商务部、总经理办公室等部门及分支机构，总经理根据业务需要决定各部门管理序列。

权益投资部：负责公司受托资产权益证券的研究和投资工作。

固定收益与平衡投资部：负责公司受托资产固定收益证券的研究和投资工作。

研究部：对宏观经济及金融市场、行业、公司进行研究，为公司旗下基金及专户管理的投资组合提供研究支持；对券商等研究机构进行评价，为交易席位分配提供客观支持。

专户管理部：主要负责公司担任投资顾问及“一对一”或“一对多”的相关专户投资业务，负责大客户的开发与维护。

交易部：负责公司旗下基金及专户管理投资的网上集中交易及网下交易等工作。

市场营销部：负责公司销售渠道的拓展及维护工作；负责公司整体营销策略的制定、实施；配合金融工程部进行新产品开发工作；负责公司网站及网上交易的开发、拓展及维护工作；为投资者提供包括但不限于基金认购、申购、赎回、业务咨询等客户服务工作。

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。

基金投资部：主要负责公司旗下基金的管理工作，进行基金投资组合管理的计划、实施，促进基金业绩目标的实现。

运作保障部：负责公司旗下基金及专户管理投资运作的后台工作，包括：基金及专户管理投资的会计、估值、核算、过户代理、清算及

结算联络等；负责规划、建设公司各项业务开展所需的信息技术系统，进行研究开发和运行支持。

计划财务部：进行公司的财务管理。

人力资源部：人力资源管理、行政管理。

监察稽核部：负责公司内部的监查稽核工作，监督公司内部控制制度的执行情况，确保国家法律、法规和公司内部管理制度的有效执行；负责公司法律事务的管理，对外合同的审核，公司对外信息披露的组织及审核等工作。

北京分公司：主要负责公司授权开展的各项工作。

机构业务部：主要负责基金销售工作的机构客户开发与维护。

电子商务部：主要负责互联网金融、产品直销和客户服务等工作。

总经理办公室：主要负责处理董事会日常事务性工作；公司营销策划、媒体联络及对外信息披露等相关工作；结合公司及子公司业务情况，开展公司整体形象宣传工作。

3、人员情况

截至 2017 年 2 月 17 日，我公司共有 155 名员工，其中博士学位 8 人、硕士学位 70 人和学士学位 68 人。

4、信息披露负责人：齐岩

咨询电话：010-68726666

5、基金管理业务情况

截至 2017 年 2 月 17 日，我公司目前已有 42 只开放式基金成立，。这 42 只已成立基金分别为：2 只货币型基金：新华壹诺宝货币市场

基金、新华活期添利货币市场基金；10只债券型基金：新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华信用增强债券型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金；28只混合型基金：新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券

投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金；1只指数分级基金：新华中证环保产业指数分级证券投资基金；1只股票型基金：新华策略精选股票型证券投资基金。

6、本基金基金经理简介

于泽雨先生：经济学博士，9年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理，于2012年10月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金经理、新华信用增强债券型证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、公司概况

名称：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

法定代表人：易会满

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

存续期间：持续经营

联系人：洪渊

联系电话：010-66105799

2、主要人员情况

截至 2016 年 9 月末,中国工商银行资产托管部共有员工 210 人,平均年龄 30 岁, 95%以上员工拥有大学本科以上学历, 高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月,中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来,本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、

香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）基金验资机构

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

法定代表人：杨剑涛

电话：010—88095588

传真：010—88091199

经办注册会计师：张伟、胡慰

联系人：胡慰

六、基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

(一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方

案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权

利或实施其他法律行为；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净

值、两级基金的基金份额参考净值、转换为上市开放式基金（LOF）后的基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金销售服务费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，在不影响现有基金份额持有人利益的前提下调整基金份额类别的设置；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起

10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（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

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(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) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、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表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票

效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，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；

（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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一。

基金合同生效之日起 3 年内，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）或类似表述均指“有效的惠鑫 A 和惠鑫 B 各自的基金份额分别合计不少于在权益登记日该级基金总份额的二分之一（含二分之一）”；在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一指“权益登记日代表的有效的惠鑫 A 和惠鑫 B 基金份额应不少于在权益登记日各级基金总份额的三分之一”，下同。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯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）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（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，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代

表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中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、受托出具书面意见的代理人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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的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事先公告的议事内容进行表决。

2、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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

基金合同生效之日起 3 年内，出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）或类似表述均指“出席大会的惠鑫 A 和惠鑫 B 各自的基金份额持有人和代理人所持该级基金份额表决权的二分之一以上（含二分之一）”，下同。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）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。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，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。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议,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的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 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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的决议。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、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

四、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;

- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市初费和上市月费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售机构的销售服务费

本基金的销售服务费年费率为 0.5%，按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为惠鑫 A 每日应计提的销售服务费

E 为惠鑫 A 前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金财产的投资方向和投资限制

如法律法规或监管部门的相关规定发生变化的，本基金履行适当程序后，基金投资的相关内容可随之改变并及时公告。

（一）投资目标

在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的资产管理，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包含国债、央票、政策性金融债及所有非国家信用的固定收益类金融工具）、股票（包含中小板、创业板及其他经中国

证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、资产支持证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(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金是债券型基金,投资于国债、中央银行票据、银行同业存款、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、可转换公司债(含分离交易的可转换公司债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、回购等债券资产占基金资产比例不低于80%;其中单只中小企业私募债占基金资产比例不高于10%。本基金将保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等非固定收益类金融工具,但可以参与一级市场新股与增发新股的申购,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的权益类金融工具,其中持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起60个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三) 投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

- (1) 本基金投资债券资产占基金资产比例不低于 80%;
- (2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%;
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- (5) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;
- (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- (8) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- (9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- (10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(14) 本基金投资于中小企业私募债券，单只中小企业私募债占基金资产比例不高于 10%。

(15) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

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有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资

或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (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) 向其基金管理人、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；

易活动；

- (7) 法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

六、基金的财产

(一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四) 基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财

产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

七、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

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

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、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

若基金合同生效之日起 3 年内，本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足惠鑫 A 的本金及应计收益分配，剩余部分（如有）由惠鑫 B 的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

若基金合同生效后 3 年期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后发生基金财产清算的情形，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 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；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 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。

八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同的存放及查阅方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅。

七、基金财务状况

（一）本基金募集期间相关费用明细

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

（二）本基金发售后至本公告书公告前的重要财务事项

本基金认购后至本公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）本基金 2017 年 2 月 17 日资产负债表（未经审计）如下：

单位：人民币元

项目	2017年2月17日
资产：	
银行存款	3,812,128.03
结算备付金	377,824.96
存出保证金	647.67
交易性金融资产	314,681,162.33
其中：股票投资	
基金投资	
债券投资	314,681,162.33
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	3,000,000.00

应收证券清算款	
应收利息	11,101,383.41
应收股利	
应收申购款	191,415.15
其他资产	
资产总计	333,164,561.55
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	299,514.75
应付赎回款	25,910.31
应付管理人报酬	144,475.60
应付托管费	41,278.77
应付销售服务费	103,196.86
应付交易费用	2,569.67
其他负债	320,492.96
负债合计	937,438.92
所有者权益：	
实收基金	186,816,391.46
未分配利润	145,410,731.17
所有者权益合计	332,227,122.63
负债和所有者权益总计	333,164,561.55

八、基金投资组合

截至 2017 年 2 月 17 日本基金的基金投资组合情况如下：

(一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	314,681,162.33	94.45
	其中：债券	314,681,162.33	94.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	3,000,000.00	0.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	4,189,952.99	1.26
6	其他资产	11,293,446.23	3.39
7	合计	333,164,561.55	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有股票。

(三) 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股票投资明细

报告期末，本基金未持有股票。

(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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	219,175,618.50	65.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	214,804.10	0.06
8	其他	95,290,739.73	28.68
9	合计	314,681,162.33	94.72

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序	债券代	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资
---	-----	------	----	---------	------

号	码		(张)		产净值比例 (%)
1	1480131	14 巴国资	300,000	32,313,000.00	9.7262%
2	1480163	13 随州 02	300,000	32,250,000.00	9.7072%
3	1480154	14 句容福地债	250,000	27,190,000.00	8.1842%
4	125367	14 美兰 01	250,000	25,027,904.11	7.5334%
5	1280024	12 东胜债	398,460	20,277,629.40	6.1035%

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末，本基金无股指期货投资。

2、 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

(九) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、 本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末，本基金无国债期货投资。

3、本基金投资国债期货的投资评价

报告期末，本基金无国债期货投资。

(十) 投资组合报告附注

1、本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本报告期内，本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	647.67
2	应收证券清算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	11,101,383.41
5	应收申购款	191,415.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,293,446.23

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自转换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、深圳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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

投资者如需了解本基金更详细信息，可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请免费查阅存放在上述机构的办公场所、营业场所的下列文件；投资者也可在支付工本费后，在合理时间内取得以下文件的复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）募集的文件；

（二）《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金合同》；

（三）《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

（四）《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）托管协议》；

（五）关于申请募集新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）之法律意见书；

（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。

新华基金管理股份有限公司

二〇一七年二月二十一日