

**亚债中国债券指数基金  
招募说明书（更新）  
2021年4月28日公告**

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。本基金基金合同于2011年5月25日正式生效。

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。本基金可能出现跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌或违约等风险。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。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人可能依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，暂停披露侧袋账户份额净值，不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

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、基金合同、基金产品资料概要，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。

**投资者应当认真阅读并完全理解基金合同规定的免责条款和规定的争议处理方式。**

本招募说明书所载内容更新编制日为2021年4月27日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2020年6月30日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 目录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 一、绪言.....                  | 1   |
| 二、释义.....                  | 1   |
| 三、基金管理人.....               | 6   |
| 四、基金托管人.....               | 14  |
| 五、相关服务机构.....              | 18  |
| 六、基金的募集.....               | 76  |
| 七、基金合同的生效.....             | 77  |
| 八、基金份额的申购、赎回与转换.....       | 77  |
| 九、基金的转托管与非交易过户等其他业务.....   | 103 |
| 十、基金的投资.....               | 104 |
| 十一、基金的业绩.....              | 112 |
| 十二、基金的财产.....              | 114 |
| 十三、基金资产的估值.....            | 114 |
| 十四、基金的收益与分配.....           | 117 |
| 十五、基金的费用与税收.....           | 118 |
| 十六、基金的会计与审计.....           | 120 |
| 十七、基金的信息披露.....            | 121 |
| 十八、侧袋机制.....               | 126 |
| 十九、风险揭示.....               | 128 |
| 二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 134 |
| 二十一、基金合同的内容摘要.....         | 135 |
| 二十二、基金托管协议的内容摘要.....       | 148 |
| 二十三、对基金份额持有人的服务.....       | 157 |
| 二十四、其他应披露事项.....           | 159 |
| 二十五、招募说明书存放及查阅方式.....      | 161 |
| 二十六、备查文件.....              | 161 |
| 附件一：标的指数编制方案.....          | 163 |

## 一、绪言

《亚债中国债券指数基金招募说明书（更新）》（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》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、中国证监会和香港证监会关于两地基金互认相关规定、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动性风险管理规定”）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、《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》及其更新。
- 基金产品资料概要：指《亚债中国债券指数基金基金产品资料概要》及其更新。

|              |  |
|--------------|--|
| 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。  |
| 中国银保监会：      | 指中国银行保险监督管理委员会。  |
| 《基金法》：       | 指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。   |
| 《运作办法》：      | 指《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。   |
| 《销售办法》：      | 指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。   |
| 《信息披露办法》：    | 指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。   |
| 《证券法》：       | 指《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订。   |
| 《流动性风险管理规定》： | 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订。                 |
| 基金合同当事人：     | 指受基金合同约束，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<br>括投资者基金账户管理、基金份额登记、清算和结算、基金<br>销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人<br>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<br>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<br>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的基金份额转为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为。
- 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。  |
| 香港销售机构：      | 指香港销售机构指经香港证监会批准的，具备基金销售资格的代为办理本基金 H 类基金份额申购、赎回和其他基金业务的相关销售机构。  |
| 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：      | 指根据销售区域、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 A 类、C 类、H 类，各基金份额类别分别设置代码，A/H 类、C 类基金份额分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。  |
| A 类/C 类基金份额： | 指在中国内地销售，以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额。A 类、C 类、H 类份额的销售费用有差异。  |
| H 类基金份额：     | 指在香港地区销售，以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额。A 类、C 类、H 类份额的销售费用有差异。  |
| 中国：          | 指中华人民共和国（就本基金而言，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区）   |
| 香港：          | 指香港特别行政区。   |
| 香港证监会：       | 指香港证券及期货事务监察委员会。  |
| 香港代表：        | 指依据香港证监会 2015 年 5 月 22 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《有关内地与香港基金互认的通函》等香港法规的规定，担任本基金在香港地区的代表，负责接收香港地区投资者的申购赎回申请、协调基金销售、向香港证监会进行报备和履行向香港基金投资者的信息披露和沟通工作等依据香港法规应履行的职责的机构。 |
| 名义持有人：       | 指依据香港市场的特点，香港代表或香港销售机构等将代表投资者名义持有“内地互认基金”（H 类基金份额）的基金份额，并出现   |



|          |  |
|----------|--|
|          | 在登记结算机构的持有人名册中的相关机构；   |
| 标的指数：    | 指 Markit 指数公司编制并发布的 iBoxx <sup>®</sup> 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、赎回或其他业务的日期。  |
| 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。  |
| 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。   |
| 流动性受限资产： | 指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。 |
| 摆动定价机制：  | 指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益                                       |

- 的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。
- 指定媒介：**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，以及中国证监会和香港证监会关于两地基金互认相关规定。
- 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、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。
- 侧袋机制：**指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户。
- 特定资产：**包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产。

### 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：北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：邱曦

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                      | 62.2%    |
| POWER CORPORATION OF CANADA     | 13.9%    |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 13.9%    |
| 天津海鹏科技咨询有限公司                    | 10%      |
| 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

杨明辉先生：董事长、党委书记，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员，华夏基金（香港）有限公司董事长。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中信信托董事，信诚基金管理有限公司董事长，中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁等。

Barry Sean McInerney先生：董事，硕士。现任万信投资公司（Mackenzie Financial Corporation）董事长、总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。

翟海涛先生：董事，硕士。现任春华资本集团总裁、合伙人，兼任中国光大国际有限公司及中国光大水务有限公司独立非执行董事等。曾任高盛（亚洲）有限责任公司董事总经理、高盛集团北京代表处首席代表、高盛集团与中国工商银行战略合作办公室主任、中国财政部和国家开发银行信用评级顾问等。

杨冰先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员、资产管理业务投资经理、资产管理业务投资主管等。

李勇进先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、中信证券财富管理委员会主任，兼任中信期货有限公司董事、中信证券华南股份有限公司董事、金通证券有限责任公司执行董事兼总经理。曾任中国农业银行大连市分行国际业务部科员，申银万国证券大连营业部部门经理，中信证券大连营业部总经理助理、副总经理、总经理，中信证

券经纪业务管理部高级副总裁、总监，中信证券（浙江）有限责任公司总经理，中信证券浙江分公司总经理，中信证券经纪业务发展与管理委员会主任等。

李一梅女士：董事、总经理，硕士。兼任证通股份有限公司董事、华夏基金（香港）有限公司董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理，上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。

张宏久先生：独立董事，硕士。现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人。兼任中信信托有限公司独立董事，全国律师协会金融专业委员会顾问，全国侨联法律顾问委员会委员及民事法律委员会主任，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员等。

支晓强先生：独立董事，博士。现任中国人民大学财务处处长、商学院财务与金融系教授、博士生导师。兼任全国会计专业学位研究生教育指导委员会委员兼副秘书长、中国会计学会财务成本分会副会长、中国会计学会内部控制专业委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会委员、北农大科技股份有限公司独立董事、哈银金融租赁有限责任公司独立董事等。

刘霞辉先生：独立董事，硕士。现任中国社会科学院经济研究所经济研究编辑部主任，国务院特殊津贴专家，二级研究员，博士生导师。兼任中国战略研究会经济战略专业委员会主任、山东大学经济社会研究院特聘兼职教授及广西南宁政府咨询专家。曾任职于国家人社部政策法规司综合处。

侯薇薇女士：监事长，学士。现任鲍尔太平洋有限公司（Power Pacific Corporation Ltd）总裁兼首席执行官，兼任加拿大鲍尔集团旗下Power Pacific Investment Management董事、投资管理委员会成员，加中贸易理事会（CCBC）的董事会成员。曾任嘉实国际资产管理公司（HGI）的全球管理委员会成员、首席业务发展官和中国战略负责人等。

史本良先生：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部行政负责人、公司副财务总监。曾任中信证券股份有限公司计划财务部B角、总监、联席负责人等。

唐士超先生：监事，博士。现任中信证券股份有限公司风险管理部市场风险与流动性风险主管。曾在中信证券股份有限公司风险管理部从事风险分析、风险计量、市场风险和流动性风险管理等工作。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室执行总经理、行政负责人，董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，

中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人。曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任华夏基金管理有限公司基金运作部B角等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

郑煜女士：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、纪委书记、基金经理等。曾任华夏证券高级分析师，大成基金高级分析师、投资经理，原中信基金股权投资部总监，华夏基金管理有限公司总经理助理等。

孙彬先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、投资经理等。曾任华夏基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理、公司总经理助理等。

张德根先生：副总经理，硕士。曾任职于北京新财经杂志社、长城证券，曾任华夏基金管理有限公司深圳分公司总经理助理、副总经理、总经理，广州分公司总经理，上海华夏财富投资管理有限公司副总经理，华夏基金管理有限公司总经理助理、研究发展部行政负责人（兼）等。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、法律部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、联席负责人，合规部行政负责人等。

蔡向阳先生：华夏基金管理有限公司高级管理人员，硕士。现任华夏基金管理有限公司高级基金经理等。曾任天相投资顾问有限公司、新华资产管理股份有限公司研究员，华夏基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理等。

## 2、本基金基金经理

刘薇女士，管理学硕士。2013年1月加入华夏基金管理有限公司，曾任固定收益部研究

员等，现任固定收益部高级副总裁，华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）、亚债中国债券指数基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏恒利3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏上证3-5年期中高级评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏上证3-5年期中高级评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏鼎兴债券型证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）、华夏恒益18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2021年1月27日起任职）。

历任基金经理：2011年5月25日至2012年8月1日期间，董元星先生任基金经理；2012年8月1日至2015年7月16日期间，邓湘伟先生任基金经理；2015年7月16日至2020年1月6日期间，柳万军先生任基金经理；2020年1月6日至2021年1月27日期间，张海静女士任基金经理。

### 3、本公司固定收益投资决策委员会

主任：范义先生，华夏基金管理有限公司固定收益总监，董事总经理，投资经理。

成员：李一梅女士，华夏基金管理有限公司董事、总经理。

阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

孙彬先生，华夏基金管理有限公司副总经理，投资经理。

曲波先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

刘明宇先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

柳万军先生，华夏基金管理有限公司固定收益部执行总经理，基金经理。

张驰先生，华夏基金管理有限公司机构债券投资部总监。

### 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、计算并公告基金净值信息，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《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《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、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了ISAE3402（《鉴证业务国际准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

##### 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) 公司引入了独立董事制度，目前有独立董事3名。董事会下设审计委员会等专门委员会。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，重视员工的合规守法意识和职业道德的培养，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，对影响目标实现的风险因素进行分析。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、控制活动

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。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度，防止越权决策。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、建立和调整投资组合并下达投资指令，对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；交易管理部负责交易执行。

③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线，交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定，基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定，对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控；风险管理部进行事中的监控；监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

#### （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人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，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，信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司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、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门，通过定期或不定期检查，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，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

#### 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

#### 1、基金托管人概况

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：任德奇

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.63亿元

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：陆志俊

电话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续12年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强，营业收入排名第162位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第11位。

截至2020年9月30日，交通银行资产总额为人民币10.80万亿元。2020年1-9月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币527.12亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。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。

## 2、主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生2020年1月起任本行董事长(其中：2019年12月至2020年7月代为履行行长职责)、执行董事，2018年8月至2020年1月任本行副董事长(其中：2019年4月至2020年1月代为履行董事长职责)、执行董事，2018年8月至2019年12月任本行行长；2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生2020年7月起担任本行行长；2016年11月至2020年5月任中国投资有限责

任公司副总经理；2014年12月至2016年11月任中国光大集团股份公司副总经理；2014年6月至2014年12月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014年6月至2016年11月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009年9月至2014年6月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993年7月至2009年9月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生2003年于香港理工大学获工商管理博士学位。

袁庆伟女士，资产托管部总经理，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管部总经理；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管部副总经理；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

### 3、基金托管业务经营情况

截至2020年9月30日，交通银行共托管证券投资基金500只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产、QDIE资金、QDLP资金和QFLP资金等产品。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

交通银行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，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，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）合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

（2）全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，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。

（3）独立性原则：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，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

（4）制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

（5）有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部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，保障各项内控管理目标被有效执行。

（6）效益性原则：托管部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《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整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办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

#### （三）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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，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。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证

券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，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。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人存在重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### （四）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、中国银保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、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：北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：张德根

网址：[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)

#### 2、代销机构：

##### （1）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：陈四清

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：王佳

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

（2）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：谷澍

客户服务电话：95599

联系人：客户服务中心

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

（3）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：刘连舸

电话：010-66596688

传真：010-66593777

联系人：客户服务中心

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

客户服务电话：95566

（4）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：田国立

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王嘉朔

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（5）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：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：高天

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

客户服务电话：95559

（6）中信银行股份有限公司

住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层

办公地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层

法定代表人：李庆萍

电话：010-65556689

传真：010-65550827

联系人：方爽

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

客户服务电话：95558

（7）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市北京东路689号

法定代表人：郑杨

电话：021-61618888

传真：021-63602431

联系人：高天、汤嘉惠

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话：95528

（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：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：高迎欣

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

联系人：董云巍

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)



（9）中国邮政储蓄银行股份有限公司

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

客户服务电话：95580

传真：010-68858117

联系人：陈春林

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

（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

电话：010-66223587

传真：010-66226045

联系人：谢小华

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

客户服务电话：95526

（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](http://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：金煜

电话：021-68475888

传真：021-68476111

联系人：王笑

网址：<http://www.bosc.cn/>

客户服务电话：95594

（13）平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市深南东路5047号

法定代表人：孙建一

电话：0755-82088888

传真：0755-25841098

联系人：张莉

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

客户服务电话：95511-3

（14）宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

联系人：胡技勋

网址：[www.nbc.cn](http://www.nbc.cn)

客户服务电话：95574

（15）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

电话：021-38523692

传真：021-50105124

联系人：施传荣

网址：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

客户服务电话：021-962999

（16）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：郭少泉

电话：0532-85709749

传真：0532-85709839

联系人：赵蓓蓓

网址：[www.qdccb.com](http://www.qdccb.com)

客户服务电话：96588（青岛）、400-669-6588（全国）

（17）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：李宏鸣

电话：0551-62667635

传真：0551-62667684

联系人：叶卓伟

网址：[www.hsbank.com.cn](http://www.hsbank.com.cn)

客户服务电话：400-889-6588

（18）东莞银行股份有限公司

住所：东莞市莞城区体育路21号

办公地址：东莞市莞城区体育路21号

法定代表人：卢国锋

电话：0769-22865177

传真：0769-23156406

联系人：朱杰霞

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

客户服务电话：0769-956033

（19）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](http://www.hzbank.com.cn)

客户服务电话：400-888-8508

（20）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](http://www.njcb.com.cn)

客户服务电话：95302

（21）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：0539-7877780  
传真：0539-8051127  
联系人：吕芳芳  
网址：[www.lsbchina.com](http://www.lsbchina.com)

客户服务电话：400-699-6588

（22）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）

（23）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：027-82656867

传真：027-82656236

联系人：黄慧琼

网址：www.hkbchina.com

客户服务电话：96558（武汉）、400-609-6558（全国）

（24）江苏银行股份有限公司

住所：南京市中华路26号

办公地址：南京市中华路26号

法定代表人：夏平

电话：025-58588167

传真：025-58588164

联系人：田春慧

网址：www.jsbchina.cn

客户服务电话：95319

（25）渤海银行股份有限公司

住所：天津市河东区海河东路218号

办公地址：天津市河东区海河东路218号

法定代表人：李伏安

电话：022-58316666

传真：-

联系人：潘鹏程

网址：[www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

客户服务电话：95541

（26）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：洛阳市洛龙区开元大道256号洛阳银行三楼306室

法定代表人：王建甫

电话：0379-65921977

传真：0379-65921869

联系人：董鹏程

网址：[www.bankofluoyang.com.cn](http://www.bankofluoyang.com.cn)

客户服务电话：0379-96699

（27）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](http://www.uccb.com.cn)

客户服务电话：0991-96518

（28）烟台银行股份有限公司

住所：山东省烟台市芝罘区海港路25号

办公地址：山东省烟台市芝罘区海港路25号

法定代表人：叶文君

电话：0535-6699660

传真：0535-6699884

联系人：王淑华

网址：[www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net)

客户服务电话：400-831-1777

（29）大连银行股份有限公司

住所：辽宁省大连市中山区中山路88号

办公地址：辽宁省大连市中山区中山路88号

法定代表人：陈占维

电话：0411-82356627

传真：0411-82356590

联系人：李格格

网址：[www.bankofdl.com](http://www.bankofdl.com)

客户服务电话：400-664-0099

（30）河北银行股份有限公司

住所：河北省石家庄市平安北大街28号

办公地址：河北省石家庄市平安北大街28号

法定代表人：乔志强

电话：0311-88627522

传真：0311-88627027

联系人：王栋

网址：[www.hebbank.com](http://www.hebbank.com)

客户服务电话：400-612-9999

（31）江苏苏州农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市吴江区中山南路1777号

办公地址：江苏省苏州市吴江区中山南路1777号

法定代表人：魏礼亚

电话：0512-63969209

传真：0512-63969209

联系人：葛晓亮

网址：<http://www.szrcb.com>

客户服务电话：96068（江苏省内）、4008696068（江苏省外）

（32）西安银行股份有限公司

住所：陕西省西安市高新路60号

办公地址：陕西省西安市高新路60号

法定代表人：郭军

电话：029-88992881

传真：029-88992475

联系人：白智

网址：www.xacbank.com

客户服务电话：400-869-6779

（33）江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常州市和平中路413号

办公地址：江苏省常州市和平中路413号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-80585939

传真：0519-89995170

联系人：蒋娇

网址：www.jnbank.com.cn

客户服务电话：0519-96005

（34）包商银行股份有限公司

住所：内蒙古包头市青山区钢铁大街6号

办公地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

电话：0472-5189051

传真：0472-5189057

联系人：刘芳

网址：www.bsb.com.cn

客户服务电话：96016（内蒙古、北京）、967210（宁波、深圳）、028-65558555（成都）

（35）厦门银行股份有限公司

住所：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦

办公地址：厦门市湖滨北路101号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

电话：0592-5310251

传真：0592-5373973

联系人：孙瑜



网址：[www.xmccb.com](http://www.xmccb.com)

客户服务电话：400-858-8888

（36）吉林银行股份有限公司

住所：吉林省长春市经济开发区1817号

办公地址：吉林省长春市经济开发区1817号

法定代表人：唐国兴

电话：0431-84999627

传真：0431-84992649

联系人：孙琦

网址：[www.jlbank.com.cn](http://www.jlbank.com.cn)

客户服务电话：400-889-6666

（37）苏州银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

法定代表人：王兰凤

电话：0512-69868373

联系人：吴骏

网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

客户服务电话：96067

（38）泉州银行股份有限公司

住所：福建省泉州市丰泽区泉泰路266号

办公地址：福建省泉州市丰泽区泉泰路266号

法定代表人：傅子能

电话：0595-22551071

传真：0595-22578871

联系人：董培姗

网址：[www.qzccb.com](http://www.qzccb.com)

客户服务电话：400-889-6312

（39）华融湘江银行股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段828号鑫远杰座

办公地址：湖南省长沙市雨花区湘府东路二段208号万境财智中心南栋

法定代表人：张永宏

电话：0731-89828592

传真：0731-89828806

联系人：曾玉姣

网址：[www.hrxjbank.com.cn](http://www.hrxjbank.com.cn)

客户服务电话：0731-96599

（40）中原银行股份有限公司

住所：河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座

办公地址：河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座

法定代表人：竇荣兴

电话：0371-85517710

传真：0371-85519869

联系人：牛映雪

网址：[www.zybank.com.cn](http://www.zybank.com.cn)

客户服务电话：95186

（41）瑞士银行（中国）有限公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际中心1220B-1230单元

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际中心1220B-1230单元

法定代表人：张琼

电话：021-23057266

传真：010-58327138

联系人：徐超

网址：<https://www.ubs.com/cn/sc/ubs-china.html>

客户服务电话：400-810-6299

（42）招商银行股份有限公司招赢通平台

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

网址：<https://fi.cmbchina.com/home>

客户服务电话：95555

（43）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：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

客户服务电话：010-66045678

（44）鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

住所：北京市朝阳区霄云路40号院1号楼3层306室

办公地址：北京市朝阳区霄云路40号院1号楼3层306室

法定代表人：齐凌峰

电话：010-82050520

传真：010-82086110

联系人：阮志凌

网址：[www.9ifund.com](http://www.9ifund.com)

客户服务电话：400-158-5050

（45）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：洪弘

电话：010-83363101

传真：010-83363072

联系人：文雯

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

客户服务电话：400-166-1188

（46）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

电话：021-20835787

传真：010-85657357

联系人：吴卫东

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

客户服务电话：400-920-0022、021-20835588

（47）江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人：吴言林

电话：025-66046166转837

联系人：孙平

网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

客户服务电话：025-66046166

（48）上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

电话：021-50810687

传真：021-58300279

联系人：李娟

网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

客户服务电话：021-50810673

（49）喜鹊财富基金销售有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人：陈皓

电话：010-58349088/18600730680

传真：010-88371180

联系人：张萌

网址：www.xiquefund.com

客户服务电话：400-699-7719

（50）腾安基金销售（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区天海二路33号腾讯海滨大厦15楼

法定代表人：刘明军

电话：0755-86013388转80618

联系人：谭广锋

网址：www.tenganxinxi.com

客户服务电话：95017

（51）北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼

法定代表人：葛新

电话：010-59403028

传真：010-59403027

联系人：孙博超

网址：www.baiyingfund.com

客户服务电话：95055-4

（52）诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼

法定代表人：汪静波

电话：021-38509680

传真：021-38509777

联系人：张裕

网址：www.noah-fund.com

客户服务电话：400-821-5399

（53）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：童彩平

网址：www.zlfund.cn

客户服务电话：4006-788-887

（54）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

电话：95021

传真：021-64385308

联系人：屠彦洋

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-181-8188

（55）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613635

传真：021-68596916

联系人：周天雪

网址：www.ehowbuy.com

客户服务电话：400-700-9665

（56）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：祖国明

电话：18205712248

联系人：韩爱斌

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

客户服务电话：4000-766-123

（57）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021-20691861

联系人：黄辉

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

客户服务电话：400-820-2899

（58）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

联系人：吴强

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

客户服务电话：400-877-3772

（59）北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088-6006

传真：010-62020355

联系人：翟飞飞

网址：www.myfund.com

客户服务电话：400-888-6661

（60）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号53楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-61101630

联系人：曹怡晨

网址：<http://www.leadfund.com.cn/>

客户服务电话：95733

（61）嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

电话：010-85097570

传真：010-85097308

联系人：余永健

网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

客户服务电话：400-021-8850

（62）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人：王兴吉

电话：010-62062880

传真：010-82057741

联系人：高雪超



网址：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

客户服务电话：4000888080

（63）北京创金启富基金销售有限公司

住所：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

法定代表人：梁蓉

电话：010-66154828-809

传真：010-88067526

联系人：马浩

网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

客户服务电话：400-6262-818

（64）泛华普益基金销售有限公司

住所：成都市成华区建设路9号高地中心1101室

办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街399号1栋1单元龙湖西宸天街B座1201号

法定代表人：于海锋

电话：13910181936

传真：-

联系人：隋亚方

网址：<https://www.puyifund.com/>

客户服务电话：400-080-3388

（65）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809

法定代表人：沈伟桦

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：程刚

网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

客户服务电话：400-609-9200

（66）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道苏宁总部

法定代表人：刘汉青

电话：025-66996699-887226

传真：025-66008800-887226

联系人：王峰

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

客户服务电话：95177

（67）浦领基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区望京东园四区2号楼10层1001号04室

办公地址：北京市朝阳区望京中航资本大厦10层

法定代表人：聂婉君

电话：010-59497361

传真：010-64788016

联系人：李艳

网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

客户服务电话：400-012-5899

（68）深圳腾元基金销售有限公司

住所：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808单元

办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808单元

法定代表人：曾革

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

联系人：鄢萌莎

网址：[www.tenyuanfund.com](http://www.tenyuanfund.com)

客户服务电话：400-687-7899

（69）通华财富（上海）基金销售有限公司

住所：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦2层

法定代表人：沈丹义

电话：021-60818757

传真：021-60810695

联系人：周晶

网址：[www.tonghuafund.com](http://www.tonghuafund.com)

客户服务电话：400-101-9301

（70）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

电话：13501068175

传真：010-56810630

联系人：马鹏程

网址：[www.chtwm.com](http://www.chtwm.com)

客户服务电话：400-898-0618

（71）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

传真：010-62680827

联系人：丁向坤

网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

客户服务电话：400-619-9059

（72）北京晟视天下投资管理有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层

法定代表人：蒋煜

电话：010-58170806

传真：010-58170910

联系人：蒋煜

网址：[www.shengshiview.com.cn](http://www.shengshiview.com.cn)

客户服务电话：010-58170761

（73）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

客户服务电话：400-893-6885

（74）北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：王军辉

客户服务电话：400-680-2123

联系人：吴鹏

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

（75）海银基金销售有限公司

住所：上海市自由贸易试验区银城中路8号4楼

办公地址：上海市自由贸易试验区银城中路8号4楼

法定代表人：惠晓川

电话：021-80134149

传真：021-80133413

联系人：秦琼

网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

客户服务电话：400-808-1016

（76）天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室

办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

网址：www.gomefund.com

客户服务电话：400-111-0889

（77）上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：申健

电话：18017373527

传真：021-20219923

联系人：张蜓

网址：<https://www.wg.com.cn/>

客户服务电话：021-20292031

（78）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座

法定代表人：赵芯蕊

电话：010-62625768

传真：010-62676582

联系人：赵芯蕊

网址：www.xincai.com

客户服务电话：010-62675369

（79）北京辉腾汇富基金销售有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B

法定代表人：许宁

电话：010-85610733

传真：010-85622351

联系人：彭雪琳

网址：<https://www.htfund.com/>

客户服务电话：400-829-1218

（80）济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

电话：010-65309516

传真：010-65330699

联系人：李海燕

网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

客户服务电话：400-673-7010

（81）上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：黄祎

电话：021-50712782

传真：021-50710161

联系人：徐亚丹

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

客户服务电话：400-799-1888

（82）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402（750000）

办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼（100000）

法定代表人：程刚

电话：010-58160168

传真：010-58160173

联系人：张旭

网址：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

客户服务电话：400-810-5919

（83）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：中国（上海）长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：尹彬彬

电话：15201924977

传真：021-52975270

联系人：兰敏

网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

客户服务电话：400-118-1188

（84）深圳市金海九州基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区富德生命保险大厦1106室

法定代表人：彭维熙

电话：0755-81994266

传真：0755-84333886

联系人：彭维熙

网址：[www.jhjzfund.com](http://www.jhjzfund.com)

客户服务电话：400-099-3333

（85）上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋

法定代表人：金佶

电话：021-33323999

传真：021-33323837

联系人：甄宝林

网址：[www.hotjjin.com](http://www.hotjjin.com)

客户服务电话：021-34013999

（86）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

电话：021-35385521\*210

传真：021-55085991

联系人：蓝杰

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

客户服务电话：400-820-5369

（87）上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132-801

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

客户服务电话：400-6767-523

（88）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：郑毓栋

电话：010-65951887

传真：010-65951887

联系人：姜颖

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

客户服务电话：400-618-0707

（89）深圳富济基金销售有限公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

法定代表人：祝中村



电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

联系人：曾瑶敏

网址：[www.fujifund.cn](http://www.fujifund.cn)

客户服务电话：0755-83999907

（90）上海攀赢基金销售有限公司

住所：上海市闸北区广中西路1207号306室

办公地址：上海市陆家嘴银城路116号大华银行大厦7楼

法定代表人：沈茹意

电话：15317992110

传真：021-68889283

联系人：孟召社

网址：<http://www.pytz.cn>

客户服务电话：021-68889082

（91）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号

法定代表人：王之光

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人：宁博宇

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

客户服务电话：400-821-9031

（92）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-89629021

传真：020-89629011

联系人：吴煜浩

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

客户服务电话：020-89629066

（93）和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房  
间

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座

法定代表人：王旋

电话：0371-85518396

传真：0371-85518397

联系人：胡静华

网址：[www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

客户服务电话：4000-555-671

（94）奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

联系人：叶健

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

客户服务电话：400-684-0500

（95）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人：钱昊旻

电话：010-59336519

传真：010-59336500

联系人：孙雯

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

客户服务电话：4008-909-998

（96）京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：王苏宁

电话：18911869618

联系人：陈龙鑫

网址：<http://fund.jd.com/>

客户服务电话：95118、400-098-8511

（97）大连网金基金销售有限公司

住所：中国大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦202

办公地址：中国大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦202

法定代表人：樊怀东

电话：13522300698

传真：0411-39027835

联系人：王清臣

网址：<http://www.yibaijin.com/>

客户服务电话：4000-899-100

（98）中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人：弭洪军

电话：021-33357030

传真：021-63353736

联系人：李娜

网址：[www.cmiwm.com](http://www.cmiwm.com)

客户服务电话：400-876-5716

（99）深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

法定代表人：赖任军

电话：0755-84355914

传真：0755-26920530

联系人：陈丽霞

网址：www.jfzinv.com

客户服务电话：400-9302-888

（100）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：袁永姣

网址：<https://danjuanapp.com>

客户服务电话：400-159-9288

（101）上海中欧财富基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号729S室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋嘉昱大厦6层

法定代表人：许欣

电话：021-68609600-5952

传真：021-33830351

联系人：黎静

网址：[www.qiangungun.com](http://www.qiangungun.com)

客户服务电话：400-700-9700

（102）天津万家财富资产管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

电话：18511290872

传真：010-59013828

联系人：邵玉磊

网址：[www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

客户服务电话：010-59013842

（103）上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路687号一幢二楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

电话：010-88066326

传真：010-63136184

联系人：张静怡

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

客户服务电话：400-817-5666

（104）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

联系人：刘宏莹

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

客户服务电话：400-990-8826

（105）弘业期货股份有限公司

住所：南京市中华路50号

办公地址：南京市中华路50号弘业大厦

法定代表人：周剑秋

电话：025-52278981

传真：025-52278733

联系人：张苏怡

网址：[www.ftol.com.cn](http://www.ftol.com.cn)

客户服务电话：400-828-1288

（106）国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：黄博铭

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

客户服务电话：95521

（107）中信建投证券股份有限公司

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：王常青

客户服务电话：95587、4008-888-108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（108）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：李颖

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

客户服务电话：95536

（109）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

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：95565

（110）广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦36楼

法定代表人：孙树明

电话：020-66336146

传真：020-87555417

联系人：陈姗姗

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575

（111）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：郑慧

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（112）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2-6层

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：陈共炎

电话：010-80928123

传真：010-66568990

联系人：辛国政

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

客户服务电话：4008-888-888或95551

（113）海通证券股份有限公司

住所：上海市黄浦区广东路689号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号

法定代表人：周杰

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

客户服务电话：95553、400-888-8001

（114）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：陈宇

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

客户服务电话：95523、400-889-5523

（115）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

传真：021-38565955

联系人：乔琳雪

网址：[www.xyq.com.cn](http://www.xyq.com.cn)

客户服务电话：95562



（116）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：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：95579、400-888-8999

（117）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：黄炎勋

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：95517

（118）西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

电话：023-67663104

传真：023-63786212

联系人：魏馨怡

网址：www.swsc.com.cn

客户服务电话：95355

（119）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：孙永祥

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：95351

（120）万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

法定代表人：张建军

电话：020-38286588

传真：020-22373718-1013

联系人：王鑫

网址：www.wlzq.com.cn

客户服务电话：95322

（121）民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

法定代表人：冯鹤年

电话：010-85127609

传真：010-85127641

联系人：韩秀萍

网址：www.msza.com

客户服务电话：95376

（122）国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

电话：0551-62257012

传真：0551-62272100

联系人：祝丽萍

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

客户服务电话：95578

（123）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：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：安志勇

电话：022-23861683

传真：022-28451892

联系人：陈玉辉

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

客户服务电话：400-651-5988

（124）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

联系人：庞晓芸

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

客户服务电话：95597

（125）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](http://www.i618.com.cn)

客户服务电话：95573

（126）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

联系人：刘晓明

网址：<http://sd.citics.com>

客户服务电话：95548

（127）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：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

客户服务电话：95330

（128）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：肖林

电话：010-83252185

传真：010-63080978

联系人：付婷

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

客户服务电话：95321

（129）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、23层、25层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层-23层、25-29层、32层、36层、39

层、40 层

法定代表人：潘鑫军

电话：021-63325888

传真：021-63326729

联系人：孔亚楠

网址：www.dfzq.com.cn

客户服务电话：95503

（130）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（131）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层

法定代表人：曹宏

电话：0755-83530715

传真：0755-83515567

联系人：梁浩

网址：www.cgws.com

客户服务电话：95514

（132）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：刘秋明

电话：021-22169999

联系人：郁疆

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

（133）中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：胡伏云

电话：020-88836999

传真：020-88836984

联系人：陈靖

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：95548

（134）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：95360

（135）南京证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路389号

办公地址：江苏省南京市江东中路389号

法定代表人：李剑锋

电话：025-58519523

传真：025-83369725

联系人：王万君

网址：www.njqz.com.cn

客户服务电话：95386

（136）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：龚德雄

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：张瑾

网址：www.shzq.com

客户服务电话：400-891-8918

（137）新时代证券股份有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：林雯

电话：010-83561146

传真：010-83561094

联系人：田芳芳

网址：www.xsdzq.cn

客户服务电话：95399

（138）大同证券有限责任公司

住所：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13

法定代表人：董祥

电话：0351-4130322

传真：0351-4192803

联系人：薛津

网址：www.dtsbc.com.cn

客户服务电话：400-712-1212

（139）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：祁昊

网址：www.glsc.com.cn

客户服务电话：95570

（140）浙商证券股份有限公司

住所：杭州市江干区五星路201号

办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼

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：95345

（141）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：何之江

电话：13916661875

传真：021-33830395

联系人：王阳

网址：www.pingan.com

客户服务电话：95511-8

（142）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人：章宏韬

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600



联系人：范超

网址：www.hazq.com

客户服务电话：95318

（143）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号

法定代表人：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

网址：www.ghzq.com.cn

客户服务电话：95563

（144）财信证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

法定代表人：蔡一兵

电话：0731-84403347

传真：0731-84403439

联系人：郭静

网址：www.cfzq.com

客户服务电话：95317

（145）东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心

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：张运勇

电话：0769-22115712、0769-22119348

传真：0769-22119423

联系人：李荣、孙旭

网址：www.dgzq.com.cn

客户服务电话：95328

（146）中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号  
法定代表人：菅明军  
电话：0371-69099882  
传真：0371-65585899  
联系人：程月艳、李盼盼、党静  
网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)  
客户服务电话：95377

（147）国都证券股份有限公司

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：翁振杰  
电话：010-84183389  
传真：010-84183311-3389  
联系人：黄静  
网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)  
客户服务电话：400-818-8118

（148）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层  
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦  
法定代表人：钱俊文  
电话：021-20333333  
传真：021-50498825  
联系人：王一彦  
网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)  
客户服务电话：95531、400-888-8588

（149）中银国际证券股份有限公司

住所：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层  
办公地址：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：宁敏

电话：021-20328000

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

网址：www.bocichina.com.cn

客户服务电话：400-620-8888

（150）国盛证券有限责任公司

住所：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼

法定代表人：徐丽峰

电话：0791-86283372、15170012175

传真：0791-86281305

联系人：占文驰

网址：www.gszq.com

客户服务电话：956080

（151）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号

法定代表人：杨炯洋

电话：010-58124967

传真：028-86150040

联系人：谢国梅

网址：www.hx168.com.cn

客户服务电话：95584

（152）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

（830002）

法定代表人：韩志谦

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

联系人：王怀春

网址：www.hysec.com

客户服务电话：400-800-0562

（153）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

传真：021-20315125

联系人：许曼华

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

（154）世纪证券有限责任公司

住所：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心

406

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层

法定代表人：李强

客户服务电话：400-832-3000

传真：0755-83199511

联系人：王雯

网址：www.csco.com.cn

（155）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-23838750

传真：0755-25838701

联系人：单晶

网址：www.firstcapital.com.cn

客户服务电话：95358

（156）金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼

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：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：马贤清

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

客户服务电话：95372

（157）中航证券有限公司

住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

法定代表人：王宜四

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

客户服务电话：95335

（158）华林证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号

办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼

法定代表人：林立

电话：0755-83255199

传真：0755-82707700

联系人：胡倩

网址：[www.chinalin.com](http://www.chinalin.com)

客户服务电话：400-188-3888

（159）德邦证券股份有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：武晓春

电话：021-68761616

传真：021-68767032

联系人：刘熠

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

客户服务电话：400-888-8128

（160）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

电话：029-87211526

传真：029-87424426

联系人：梁承华

网址：[www.westsecu.com](http://www.westsecu.com)

客户服务电话：95582

（161）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至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.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

客户服务电话：95547

（162）华龙证券股份有限公司

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](http://www.hlzqgs.com)

客户服务电话：95368、400-468-8888（全国）

（163）中国国际金融股份有限公司

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：金立群

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉、武明明

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

客户服务电话：010-65051166

（164）财通证券股份有限公司

住所：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

电话：0571-87925129

传真：0571-87818329

联系人：夏吉慧

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

客户服务电话：95336

（165）上海华信证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心

办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼

法定代表人：陈灿辉

电话：021-63898427

传真：021-68776977-8427

联系人：徐璐

网址：[www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

客户服务电话：400-820-5999

（166）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

电话：021-54967656

传真：021-54967032

联系人：虞佳彦

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：95323、400-109-9918

（167）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：程宜荪

电话：010-58328112

传真：010-58328748

联系人：牟冲

网址：www.ubssecurities.com

客户服务电话：400-887-8827

（168）中国中金财富证券有限公司

住所：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-21层及第04层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

联系人：胡芷境

网址：www.china-invs.cn

客户服务电话：400-600-8008、95532

（169）中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层



办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人：吴小静

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

联系人：罗艺琳

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

客户服务电话：95329

（170）东方财富证券股份有限公司

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：<http://www.18.cn>

客户服务电话：95357

（171）国融证券股份有限公司

住所：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层

法定代表人：张智河

电话：010-83991719

传真：010-66412537

联系人：叶密林

网址：<https://www.grzq.com>

客户服务电话：95385

（172）粤开证券股份有限公司

住所：广州经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层

办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层

法定代表人：严亦斌

电话：0755-83331195

联系人：彭莲

网址：<http://www.ykzq.com>

客户服务电话：95564

（173）江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

联系人：姜志伟

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

客户服务电话：956007

（174）国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

客户服务电话：95310

（175）华宝证券有限责任公司

住所：上海市陆家嘴环路166号27楼

办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼

法定代表人：陈林

电话：021-50122128

传真：021-50122398

联系人：徐方亮

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

客户服务电话：400-820-9898

（176）长城国瑞证券有限公司

住所：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层

办公地址：福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼

法定代表人：王勇

电话：0592-2079259

传真：0592-2079602

联系人：邱震

网址：[www.gwgsc.com](http://www.gwgsc.com)

客户服务电话：400-0099-886

（177）爱建证券有限责任公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

法定代表人：祝健

电话：021-32229888

传真：021-68728703

联系人：庄丽珍

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

客户服务电话：400-196-2502

（178）华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦

法定代表人：祝献忠

电话：010-85556048

传真：010-85556088

联系人：孙燕波

网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

客户服务电话：95390

（179）天风证券股份有限公司

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：400-800-5000

（180）万和证券股份有限公司

住所：海口市南沙路49号通信广场二楼

办公地址：深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦20层西厅

法定代表人：冯周让

电话：0755-82830333

传真：0755-25842783

联系人：王少峰

网址：<http://www.wanhesec.com.cn>

客户服务电话：4008-882-882

（181）宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼

办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

电话：028-86199278

传真：028-86199382

联系人：郝俊杰

网址：www.hxzq.cn

客户服务电话：400-836-6366

（182）太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元

法定代表人：李长伟

电话：010-88321717、18500505235

传真：010-88321763

联系人：唐昌田

网址：www.tpyzq.com

客户服务电话：95397

（183）开源证券股份有限公司

住所：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

电话：029-88447611

传真：029-88447611

联系人：曹欣

网址：www.kysec.cn

客户服务电话：95325、400-860-8866

（184）联储证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层

法定代表人：吕春卫

电话：010-86499427

传真：010-86499401

联系人：丁倩云

网址：www.lczq.com

客户服务电话：400-620-6868

（185）华瑞保险销售有限公司

住所：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层

办公地址：上海市浦东新区向城路288号国华人寿金融大厦8层806

法定代表人：路昊

电话：021-68595698

传真：021-68595766

联系人：茆勇强

网址：www.huaruisales.com

客户服务电话：952303

（186）玄元保险代理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谔

电话：13752528013

传真：021-50701053

联系人：卢亚博

网址：[http://www.xyinsure.com:7100/kfit\\_xybx](http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx)

客户服务电话：400-080-8208

（187）阳光人寿保险股份有限公司

住所：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

网址：<http://fund.sinosig.com/>

客户服务电话：95510

（188）中国人寿保险股份有限公司

住所：中国北京市西城区金融大街16号

办公地址：中国北京市西城区金融大街16号

法定代表人：王滨

电话：010-63631536

传真：010-66222276

联系人：柳亚卿

网址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

客户服务电话：95519

（189）江苏紫金农村商业银行股份有限公司

住所：南京市建邺区江东中路381号

办公地址：南京市建邺区江东中路381号

法定代表人：张小军

电话：025-88866645

传真：025-88866451

联系人：葛宜楷

网址：www.zjrcbank.com

客户服务电话：96008

基金管理人可以根据情况增加或者减少销售机构。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：北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：杨明辉

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：朱威

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：李晗

经办律师：吴冠雄、李晗

（四）会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：王珊珊

经办注册会计师：王珊珊、马剑英

## 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<sup>®</sup>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。EMEAP以专户资产（含现券和现金）换购为基金份额继续持有。

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。

### （二）基金的募集情况

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。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期限为不定期。

本基金募集期间基金份额净值为人民币1.00元，按面值发售。

本基金自2011年4月26日至2011年5月23日进行发售。

本基金设立募集期共募集2,927,413,641.76份基金份额，其中包括EMEAP以现券和少量现金的形式认购的本基金A类基金份额共计2,136,796,293.57份（含利息结转的份额）。有效认购户数为7,693户。



## 七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于2011年5月25日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

如本基金经认可在香港公开销售，除本基金的有关公告（如为在香港销售编制的招募说明书补充文件）及香港销售机构的业务规则另有专门规定外，本基金在香港的申购、赎回及转换等销售业务，应当根据本招募说明书办理。

### （一）基金份额设置

本基金根据销售区域、认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售，以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额，投资者认购/申购时收取前端认购/申购费的，称为A类；在中国内地销售，以人民币计价并进行认购、申购、赎回的份额，不收取前后端认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类；在香港地区销售，以人民币计价并进行申购、赎回的份额，投资者申购时收取前端申购费的，称为H类。A类、C类、H类份额的销售费用有所不同。投资者通过中国内地的销售机构申购基金份额时仅可申购A类、C类基金份额，投资者通过香港销售机构申购基金份额时仅可申购H类基金份额。A类、C类、H类基金份额分别设置代码，A类/H类基金份额与C类基金份额分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。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。

### （二）申购和赎回场所

#### 1、A类及C类基金份额直销机构

本基金直销机构为本公司北京分公司、上海分公司、深圳分公司、南京分公司、杭州分

公司、广州分公司、成都分公司，设在北京、广州的投资理财中心以及电子交易平台。

（1）北京分公司

地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1层（100033）

电话：010-88087226

传真：010-88066028

（2）北京东中街投资理财中心

地址：北京市东城区东中街29号东环广场B座一层（100027）

电话：010-64185183

传真：010-64185180

（3）北京科学院南路投资理财中心

地址：北京市海淀区中关村科学院南路9号（新科祥园小区大门口一层）（100190）

电话：010-82523198

传真：010-82523196

（4）北京东四环投资理财中心

地址：北京市朝阳区八里庄西里100号住邦2000商务中心1号楼一层（100025）

电话：010-85869755

传真：010-85869575

（5）北京望京投资理财中心

地址：北京市朝阳区望京宏泰东街绿地中国锦103（100102）

电话：010- 64709882

传真：010- 64702330

（6）上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1902室（200120）

电话：021-58771599

传真：021-58771998

（7）深圳分公司

地址：深圳市福田区莲花街道益田路6001号太平金融大厦40层02室（518038）

电话：0755-82033033

传真：0755-82031949

（8）南京分公司

地址：南京市鼓楼区汉中路2号金陵饭店亚太商务楼30层B区（210005）

电话：025-84733916

传真：025-84733928

（9）杭州分公司

地址：浙江省杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场B区4层G05、G06室（310007）

电话：0571-89716606

传真：0571-89716611

（10）广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼5305房（510623）

电话：020-38461058

传真：020-38067182

（11）广州天河投资理财中心

地址：广州市天河区珠江西路5号5306房（510623）

电话：020-38460001

传真：020-38067182

（12）成都分公司

地址：成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座1栋1单元14层1406-1407号  
（610000）

电话：028-65730073

传真：028-86725411

（13）电子交易

本公司电子交易包括网上交易、移动客户端交易等。投资者可以通过本公司网上交易系统或移动客户端办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)。

## 2、A类及C类基金份额代销机构

本基金代销机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“（一）销售机构”的相关描述。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法另行公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。

3、H类基金份额的销售机构为经香港证监会批准的，具备基金销售资格的由香港代表选聘或基金管理人直接选聘的相关销售机构。

### （三）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A类基金份额及C类基金份额申购、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。H类基金份额的开放日及具体业务办理时间详见招募说明书补充文件。

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

本基金已于2011年7月4日起开始办理A类基金份额及C类基金份额日常赎回、转换转出业务，于2011年9月1日起开始办理日常申购、转换转入业务。H类基金份额开始办理日常申购、赎回业务的时间具体在其他相关公告中载明。

### （四）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；投资者通过中国的销售机构申购基金份额时仅可申购A类、C类基金份额，投资者通过香港的销售机构申购基金份额时仅可申购H类基金份额。

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介公告。

### （五）申购和赎回的数额限制

1、投资者通过直销机构或华夏财富办理本基金的申购及赎回业务，每次最低申购金额为 1.00 元（含申购费），每次赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在直销机构或华夏财富保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。具体业务办理请遵循基金管理人直销机构及华夏财富的相关规定。

2、投资者通过其他代销机构办理本基金的申购及赎回业务，每次最低申购金额、每次最低赎回份额、基金份额持有人赎回时或赎回后在该代销机构（网点）保留的最低基金份额余额以各代销机构的规定为准。具体业务办理请遵循各代销机构的相关规定。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

4、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介上公告。

### （六）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。

H 类基金份额的开放日与 A 类基金份额及 C 类基金份额的开放日有所不同，因此本基金 H 类基金份额的投资者向香港销售机构或以香港销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况的具体时间见招募说明书补充文件的规定。

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。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

#### （七）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1,000.00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、H 类份额的申购费

投资人申购 H 类基金份额，申购费率最高不超过申购金额的 5%。具体申购费率和缴纳方式由销售机构自行决定。

4、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 7 天的，收取 1.5% 的赎回费，赎回时份额持有满 7 天（含 7 天）不满 30 天的，收取 0.1% 的赎回费，持有满 30 天以上（含 30 天）的，赎回费为 0。其中，对于赎回时份额持有不满 7 天的，收取的赎回费全额计入基金资产；对赎回时份额持有满 7 天以上（含 7 天）收取的赎回费，所收取赎回费总额的 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。

#### 5、H 类份额的赎回费

对于 H 类份额，赎回时份额持有不满 7 天的，收取 1.5% 的赎回费，赎回时份额持有满 7 天以上（含 7 天）的，收取赎回金额 0.075% 的赎回费。收取的赎回费全部归入基金资产。

6、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介公告。

7、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介公告。

8、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

（八）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类或H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：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{该类基金份额前端申购费率})$$

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

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

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

（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。

例一：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 |

例二：假定T日基金的H类基金份额净值为1.230元，其申购费率为0.8%，若某笔H类基金份额的申购金额分别为1,000元，则该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    |
|----------------------|--------|
| 申购金额（元，a）            | 1,000  |
| 适用前端申购费率（b）          | 0.8%   |
| 净申购金额（ $c=a/(1+b)$ ） | 992.06 |
| 前端申购费（ $d=a-c$ ）     | 7.94   |
| 该类基金份额净值（e）          | 1.230  |
| 申购份额（ $f=c/e$ ）      | 806.55 |

例三：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：

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

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

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

(3) 当投资者赎回H类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

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

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

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

例四：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：

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

$$\text{赎回费用} = 12,500 \times 0.1\% = 12.50 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500 - 12.50 = 12,487.50 \text{元}$$

例五：假定某投资者在T日赎回10,000份C类基金份额，持有期限30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：

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



例六：假定某投资者在T日赎回10,000份H类基金份额，持有期限50天，该日H类基金份额净值为1.250元，则其获得的赎回金额计算如下：

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

$$\text{赎回费用} = 12,500 \times 0.075\% = 9.38 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500 - 9.38 = 12,490.62 \text{元}$$

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。

#### （九）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。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 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、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。
- 9、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。

除本基金合同中规定的拒绝或暂停申购情形外，当发生以下情形时，本基金管理人可拒绝或暂停接受H类基金份额的申购申请：

- 1、全部内地互认基金的人民币跨境金额达到或超过国家规定的总额度；
- 2、H类基金份额的规模占基金资产的比例高于50%。

（十）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。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 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。

（十一）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。香港销售机构对持有H类基金份额投资者的选择权另有规定的，按其规定办理。

当发生巨额赎回并部分延期办理时，基金管理人应在2日内通过至少一种指定媒介刊登公告，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介公告。

（3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的大额赎回申请情形下，如果基金管理人认为支付全部投资人的赎回申请有困难或认为因支付全部投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延期办理赎回申请。具体分为两种情况：

①如果基金管理人认为有能力支付其他投资人的全部赎回申请，为了保护其他赎回投资人的利益，对于其他投资人的赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过基金总份额20%以上的大额赎回申请，基金管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的赎回份额，未确认的赎回部分作自动延期处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时选择取消赎回的，则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果基金管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时，则所有投资人的赎回申请（包括单个投资人超过基金总份额20%以上的大额赎回申请和其他投资人的赎回申请）都按照上述“（2）部分延期赎回”的约定一并办理。

（十二）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介公告：

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介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介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介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。

### （十三）基金的转换

基金管理人另行公告前，本基金暂不办理H类份额的转换业务。

#### 1、基金转换的原则

（1）投资者只可在同时销售转出基金及转入基金的机构办理基金转换业务。

（2）基金转换以份额为单位进行申请。

（3）基金转换采取“未知价”法，即基金的转换价格以转换申请受理当日转出、转入基金的份额净值为基准进行计算。

（4）投资者T日申请基金转换后，T+1日可获得确认。

（5）除另有规定外，基金份额持有人单笔转出申请遵循转出基金有关赎回份额的限制，单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

（6）发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请可根据投资者事先的选择和代销机构的相关规定予以顺延或撤销基金转换。

（7）投资者办理基金转换业务时，转出基金必须处于可赎回状态，转入基金必须处于可申购状态。

由于各代销机构系统及业务安排等原因，可能开展基金转换业务的时间有所不同，投资者应参照各代销机构的具体规定。

基金管理人有权根据市场情况调整转换的程序及有关限制，但应最迟在调整生效前2个工作日在至少一种中国证监会指定媒介公告。

## 2、暂停基金转换的情形及处理

出现下列情况之一时，基金管理人可以暂停基金转换业务：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作。
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，基金管理人认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请。
- （4）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换申请。
- （5）基金管理人认为有正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的。
- （6）发生基金合同规定的暂停基金申购或赎回的情形。
- （7）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应于规定期限内至少在一种中国证监会指定媒介上刊登暂停公告。重新开放基金转换时，基金管理人应及时至少在一种中国证监会指定媒介上刊登重新开放基金转换的公告。

## 3、基金转换费用

- （1）基金转换费：无。
- （2）转出基金费用：按转出基金赎回时应收的赎回费收取，如该部分基金采用后端收费模式购买，除收取赎回费外，还需收取赎回时应收的后端申购费。转换金额指扣除赎回费与后端申购费（若有）后的余额。

（3）转入基金费用：转入基金申购费用根据适用的转换情形收取，具体如下：

### ①从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档—转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例一。

### ②从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率，转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档

高，则收取的申购费用为转入基金适用的固定费用；反之，收取的申购费用为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例二。

③从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：前端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例三。

④从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例四。

⑤从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用，转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档—转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例五。

⑥从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用固定费用。

费用收取方式：收取的申购费用=转入基金申购费用—转出基金申购费用，最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例六。

⑦从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：前端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例七。

⑧从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例八。

⑨从后端收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档—转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例九。

⑩从后端收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档高，则收取的申购费用为转入基金适用的固定费用；反之，收取的申购费用为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十。

⑪从后端收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额。

费用收取方式：后端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十一。

⑫从后端收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十二。

⑬从不收取申购费用的基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的

其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率=转入基金的申购费率-转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间（单位为年），最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十三。

⑭从不收取申购费用基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：收取的申购费用=固定费用-转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间（单位为年），最低为0。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十四。

⑮从不收取申购费用的基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用的基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十五。

⑯从不收取申购费用的基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“4、业务举例”中例十六。

⑰对于货币基金的基金份额转出情况的补充说明

对于货币型基金，每当有基金新增份额时，均调整持有时间，计算方法如下：

调整后的持有时间=原持有时间×原份额/（原份额+新增份额）

（4）上述费用另有优惠的，从其规定。

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整基金转换的有关业务规则。

#### 4、业务举例

例一：假定投资者在 T 日转出 1,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。

（1）若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的前端申购费率最高档为 2.0%，



该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算           |
|--------------------|----------------|
| 转出份额 (A)           | 1,000.00       |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200          |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,200.00       |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%           |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 6.00           |
| 转换金额 (F=C-E)       | 1,194.00       |
| 转入时收取申购费率 (G)      | 2.0%-1.5%=0.5% |
| 净转入金额 (H=F/(1+G))  | 1,188.06       |
| 转入基金费用 (I=F-H)     | 5.94           |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (J) | 1.300          |
| 转入基金份额 (K=H/J)     | 913.89         |

(2)若 T 日转入丙基金(前端收费模式),且丙基金适用的前端申购费率最高档为 1.2%,  
该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算     |
|--------------------|----------|
| 转出份额 (A)           | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200    |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,200.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%     |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 6.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 1,194.00 |
| 转入时收取申购费率 (G)      | 0.00%    |
| 净转入金额 (H=F/(1+G))  | 1,194.00 |
| 转入基金费用 (I=F-H)     | 0.00     |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (J) | 1.300    |
| 转入基金份额 (K=H/J)     | 918.46   |

例二：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），甲基金申购费率适用比例费率，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。

(1) 若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为 1,000 元，乙基金前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算          |
|--------------------|---------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200         |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%          |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00     |

|                    |               |
|--------------------|---------------|
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00 |
| 转入基金费用 (G)         | 1,000.00      |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 11,939,000.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.300         |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 9,183,846.15  |

(2) 若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算          |
|--------------------|---------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200         |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%          |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00 |
| 转入基金费用 (G)         | 0.00          |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 11,940,000.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.300         |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 9,184,615.38  |

例三：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算     |
|--------------------|----------|
| 转出份额 (A)           | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200    |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,200.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%     |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 6.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 1,194.00 |
| 转入基金费用 (G)         | 0.00     |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 1,194.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.500    |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 796.00   |

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期在 1 年之内，适用后端申购费率为 1.2%，此时赎回乙基金不收取赎回费，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

| 项目 | 费用计算 |
|----|------|
|----|------|

|                       |          |
|-----------------------|----------|
| 赎回份额 (K)              | 796.00   |
| 赎回日基金份额净值 (L)         | 1.300    |
| 赎回总金额 (M=K*L)         | 1,034.80 |
| 赎回费用 (N)              | 0.00     |
| 适用后端申购费率 (O)          | 1.2%     |
| 后端申购费 (P=K*I*O/(1+O)) | 14.16    |
| 赎回金额 (Q=M-N-P)        | 1,020.64 |

例四：假定投资者在 T 日转出前端收费基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。

T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算     |
|--------------------|----------|
| 转出份额 (A)           | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.300    |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,300.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%     |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 6.50     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 1,293.50 |
| 转入基金费用 (G)         | 0.00     |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 1,293.50 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.500    |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 862.33   |

例五：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），甲基金申购费率适用固定费用，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.2%，赎回费率为 0.5%。

(1) 若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金申购费率适用比例费率，乙基金前端申购费率最高档为 1.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算           |
|--------------------|----------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00  |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200          |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00  |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%           |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00      |
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00  |
| 转入时收取申购费率 (G)      | 1.5%-1.2%=0.3% |
| 净转入金额 (H=F/(1+G))  | 11,904,287.14  |
| 转入基金费用 (I=F-H)     | 35,712.86      |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (J) | 1.300          |
| 转入基金份额 (K=H/J)     | 9,157,143.95   |

(2) 若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金申购费率适用比例费率，丙基金前端申购费率最高档为 1.0%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算          |
|--------------------|---------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200         |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%          |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00 |
| 转入时收取申购费率 (G)      | 0.00%         |
| 净转入金额 (H=F/(1+G))  | 11,940,000.00 |
| 转入基金费用 (I=F-H)     | 0.00          |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (J) | 1.300         |
| 转入基金份额 (K=H/J)     | 9,184,615.38  |

例六：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金赎回费率为 0.5%。

(1) 若 T 日转入乙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为 500 元，乙基金适用的申购费用为 1,000 元，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算             |
|--------------------|------------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00    |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200            |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00    |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%             |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00        |
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00    |
| 转入基金费用 (G)         | 1,000-500=500.00 |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 11,939,500.00    |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.300            |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 9,184,230.77     |

(2) 若 T 日转入丙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金适用的申购费用为 500 元，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算          |
|--------------------|---------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200         |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00 |

|                    |               |
|--------------------|---------------|
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%          |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00 |
| 转入基金费用 (G)         | 0.00          |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 11,940,000.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.300         |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 9,184,615.38  |

例七：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲 10,000,000 份，转入后端收费基金乙，甲基金申购费率适用固定费用，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算          |
|--------------------|---------------|
| 转出份额 (A)           | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200         |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 12,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%          |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 60,000.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 11,940,000.00 |
| 转入基金费用 (G)         | 0.00          |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 11,940,000.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.500         |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 7,960,000.00  |

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期在 1 年之内，适用后端申购费率为 1.2%，此时赎回乙基金不收取赎回费，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

| 项目                    | 费用计算          |
|-----------------------|---------------|
| 赎回份额 (K)              | 7,960,000.00  |
| 赎回日基金份额净值 (L)         | 1.300         |
| 赎回总金额 (M=K*L)         | 10,348,000.00 |
| 赎回费用 (N)              | 0.00          |
| 适用后端申购费率 (O)          | 1.2%          |
| 后端申购费 (P=K*I*O/(1+O)) | 141,581.03    |
| 赎回金额 (Q=M-N-P)        | 10,206,418.97 |

例八：假定投资者在 T 日转出前端收费基金甲 10,000,000 份，转入不收取申购费用基金乙，甲基金申购费率适用固定费用。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目       | 费用计算          |
|----------|---------------|
| 转出份额 (A) | 10,000,000.00 |

|                    |               |
|--------------------|---------------|
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.300         |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 13,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%          |
| 转出基金费用(E=C*D)      | 65,000.00     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 12,935,000.00 |
| 转入基金费用 (G)         | 0.00          |
| 净转入金额 (H=F-G)      | 12,935,000.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (I) | 1.500         |
| 转入基金份额 (J=H/I)     | 8,623,333.33  |

例九：假定投资者在 T 日转出 1,000 份持有期为半年的甲基金基金份额(后端收费模式)，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.8%，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。申购日甲基金基金份额净值为 1.100 元。

(1)若 T 日转入乙基金(前端收费模式)，且乙基金适用的前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                    | 费用计算           |
|-----------------------|----------------|
| 转出份额 (A)              | 1,000.00       |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B)    | 1.200          |
| 转出总金额 (C=A*B)         | 1,200.00       |
| 转出基金赎回费率 (D)          | 0.5%           |
| 赎回费 (E=C*D)           | 6.00           |
| 申购日转出基金基金份额净值 (F)     | 1.100          |
| 适用后端申购费率 (G)          | 1.8%           |
| 后端申购费 (H=A*F*G/(1+G)) | 19.45          |
| 转出基金费用 (I=E+H)        | 25.45          |
| 转换金额 (J=C-I)          | 1,174.55       |
| 转入时收取申购费率 (K)         | 2.0%-1.5%=0.5% |
| 净转入金额 (L=J/(1+K))     | 1,168.71       |
| 转入基金费用 (M=J-L)        | 5.84           |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (N)    | 1.300          |
| 转入基金份额 (O=L/N)        | 899.01         |

(2)若 T 日转入丙基金(前端收费模式)，且丙基金适用的前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算     |
|--------------------|----------|
| 转出份额 (A)           | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200    |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,200.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.5%     |
| 赎回费 (E=C*D)        | 6.00     |
| 申购日转出基金基金份额净值 (F)  | 1.100    |
| 适用后端申购费率 (G)       | 1.8%     |

|   |          |
|---|----------|
| 后端申购费 ( $H=A \times F \times G / (1+G)$ ) | 19.45    |
| 转出基金费用 ( $I=E+H$ )                        | 25.45    |
| 转换金额 ( $J=C-I$ )                          | 1,174.55 |
| 转入时收取申购费率 ( $K$ )                         | 0.00%    |
| 净转入金额 ( $L=J/(1+K)$ )                     | 1,174.55 |
| 转入基金费用 ( $M=J-L$ )                        | 0.00     |
| 转入基金 T 日基金份额净值 ( $N$ )                    | 1.300    |
| 转入基金份额 ( $O=L/N$ )                        | 903.50   |

例十：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份持有期为半年的甲基金基金份额（后端收费模式），转出时适用甲基金后端申购费率为 1.8%，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。申购日甲基金基金份额净值为 1.100 元。

（1）若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为 1,000 元，乙基金前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目  | 费用计算          |
|---|---------------|
| 转出份额 (A)                                  | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B)                        | 1.200         |
| 转出总金额 ( $C=A \times B$ )                  | 12,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)                              | 0.5%          |
| 赎回费 ( $E=C \times D$ )                    | 60,000.00     |
| 申购日转出基金基金份额净值 (F)                         | 1.100         |
| 适用后端申购费率 (G)                              | 1.8%          |
| 后端申购费 ( $H=A \times F \times G / (1+G)$ ) | 194,499.02    |
| 转出基金费用 ( $I=E+H$ )                        | 254,499.02    |
| 转换金额 ( $J=C-I$ )                          | 11,745,500.98 |
| 转入基金费用 (K)                                | 1,000.00      |
| 净转入金额 ( $L=J-K$ )                         | 11,744,500.98 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (M)                        | 1.300         |
| 转入基金份额 ( $N=L/M$ )                        | 9,034,231.52  |

（2）若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                       | 费用计算          |
|--------------------------|---------------|
| 转出份额 (A)                 | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B)       | 1.200         |
| 转出总金额 ( $C=A \times B$ ) | 12,000,000.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)             | 0.5%          |

|                       |               |
|-----------------------|---------------|
| 赎回费 (E=C*D)           | 60,000.00     |
| 申购日转出基金基金份额净值 (F)     | 1.100         |
| 适用后端申购费率 (G)          | 1.8%          |
| 后端申购费 (H=A×F×G/(1+G)) | 194,499.02    |
| 转出基金费用 (I=E+H)        | 254,499.02    |
| 转换金额 (J=C-I)          | 11,745,500.98 |
| 转入基金费用 (K)            | 0.00          |
| 净转入金额 (L=J-K)         | 11,745,500.98 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (M)    | 1.300         |
| 转入基金份额 (N=L/M)        | 9,035,000.75  |

例十一：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有期为 3 年的后端收费基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.0%，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。申购当日甲基金基金份额净值为 1.100 元，适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                    | 费用计算     |
|-----------------------|----------|
| 转出份额 (A)              | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B)    | 1.300    |
| 转出总金额 (C=A*B)         | 1,300.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)          | 0.5%     |
| 赎回费 (E=C*D)           | 6.50     |
| 申购日转出基金基金份额净值 (F)     | 1.100    |
| 适用后端申购费率 (G)          | 1.0%     |
| 后端申购费 (H=A×F×G/(1+G)) | 10.89    |
| 转出基金费用 (I=E+H)        | 17.39    |
| 转换金额 (J=C-I)          | 1,282.61 |
| 转入基金费用 (K)            | 0.00     |
| 净转入金额 (L=J-K)         | 1,282.61 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (M)    | 1.500    |
| 转入基金份额 (N=L/M)        | 855.07   |

若投资者在 2012 年 9 月 15 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为 2 年半，适用后端申购费率为 1.2%，且乙基金赎回费率为 0.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

| 项目            | 费用计算     |
|---------------|----------|
| 赎回份额 (O)      | 855.07   |
| 赎回日基金份额净值 (P) | 1.300    |
| 赎回总金额 (Q=O*P) | 1,111.59 |
| 赎回费率 (R)      | 0.5%     |
| 赎回费 (S=Q*R)   | 5.56     |



|                          |          |
|--------------------------|----------|
| 适用后端申购费率（T）              | 1.2%     |
| 后端申购费（ $U=O*M*T/(1+T)$ ） | 15.21    |
| 赎回金额（ $V=Q-S-U$ ）        | 1,090.82 |

例十二：假定投资者在 T 日转出持有期为 3 年的后端收费基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。申购当日甲基金基金份额净值为 1.100 元，赎回费率为 0.5%，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.0%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                       | 费用计算     |
|--------------------------|----------|
| 转出份额（A）                  | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值（B）        | 1.200    |
| 转出总金额（ $C=A*B$ ）         | 1,200.00 |
| 转出基金赎回费率（D）              | 0.5%     |
| 赎回费（ $E=C*D$ ）           | 6.00     |
| 申购日转出基金基金份额净值（F）         | 1.100    |
| 适用后端申购费率（G）              | 1.0%     |
| 后端申购费（ $H=A*F*G/(1+G)$ ） | 10.89    |
| 转出基金费用（ $I=E+H$ ）        | 16.89    |
| 转换金额（ $J=C-I$ ）          | 1,183.11 |
| 转入基金费用（K）                | 0.00     |
| 净转入金额（ $L=J-K$ ）         | 1,183.11 |
| 转入基金 T 日基金份额净值（M）        | 1.500    |
| 转入基金份额（ $N=L/M$ ）        | 788.74   |

例十三：假定投资者在 T 日转出持有期为 146 天的不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入前端收费基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.300 元。甲基金销售服务费率为 0.3%，此时转出不收取赎回费。乙基金适用申购费率为 2.0%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                                 | 费用计算     |
|------------------------------------|----------|
| 转出份额（A）                            | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值（B）                  | 1.200    |
| 转出总金额（ $C=A*B$ ）                   | 1,200.00 |
| 转出基金费用（D）                          | 0.00     |
| 转换金额（ $E=C-D$ ）                    | 1,200.00 |
| 销售服务费率（F）                          | 0.3%     |
| 转入基金申购费率（G）                        | 2.0%     |
| 收取的申购费率（ $H=G-F*转出基金的持有时间（单位为年）$ ） | 1.88%    |
| 净转入金额（ $I=E/(1+H)$ ）               | 1,177.86 |
| 转入基金费用（ $J=E-I$ ）                  | 22.14    |
| 转入基金 T 日基金份额净值（K）                  | 1.300    |

|                |        |
|----------------|--------|
| 转入基金份额 (L=I/K) | 906.05 |
|----------------|--------|

例十四：假定投资者在 T 日转出持有期为 10 天的不收取申购费用基金甲 10,000,000 份，转入前端收费基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.300 元。甲基金销售服务费率为 0.3%，此时转出不收取赎回费。乙基金适用固定申购费 1,000.00 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                                | 费用计算          |
|-----------------------------------|---------------|
| 转出份额 (A)                          | 10,000,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B)                | 1.200         |
| 转出总金额 (C=A*B)                     | 12,000,000.00 |
| 转出基金费用 (D)                        | 0.00          |
| 转换金额 (E=C-D)                      | 12,000,000.00 |
| 销售服务费率 (F)                        | 0.3%          |
| 转入基金申购费用 (G)                      | 1,000.00      |
| 转入基金费用 (H=G-E*F*转出基金的持有时间 (单位为年)) | 13.70         |
| 净转入金额 (I=E-H)                     | 11,999,986.30 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (J)                | 1.300         |
| 转入基金份额 (K=I/J)                    | 9,230,758.69  |

例十五：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有 60 天的不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。此时转出甲基金不收取赎回费。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算     |
|--------------------|----------|
| 转出份额 (A)           | 1,000    |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.200    |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,200.00 |
| 转出基金费用 (D)         | 0.00     |
| 转换金额 (E=C-D)       | 1,200.00 |
| 转入基金费用 (F)         | 0.00     |
| 净转入金额 (G=E-F)      | 1,200.00 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (H) | 1.500    |
| 转入基金份额 (I=G/H)     | 800.00   |

若投资者在 2013 年 9 月 15 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为 3 年半，适用后端申购费率为 1.0%，且乙基金赎回费率为 0.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

| 项目            | 费用计算   |
|---------------|--------|
| 赎回份额 (J)      | 800.00 |
| 赎回日基金份额净值 (K) | 1.300  |

|                       |          |
|-----------------------|----------|
| 赎回总金额 (L=J*K)         | 1,040.00 |
| 赎回费率 (M)              | 0.5%     |
| 赎回费 (N=L*M)           | 5.20     |
| 适用后端申购费率 (O)          | 1.0%     |
| 后端申购费 (P=J*H*O/(1+O)) | 11.88    |
| 赎回金额 (Q=L-N-P)        | 1,022.92 |

例十六：假定投资者在 T 日转出不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.1%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

| 项目                 | 费用计算     |
|--------------------|----------|
| 转出份额 (A)           | 1,000.00 |
| 转出基金 T 日基金份额净值 (B) | 1.300    |
| 转出总金额 (C=A*B)      | 1,300.00 |
| 转出基金赎回费率 (D)       | 0.1%     |
| 转出基金费用 (E=C*D)     | 1.30     |
| 转换金额 (F=C-E)       | 1,298.70 |
| 转入基金费用 (F)         | 0.00     |
| 净转入金额 (G=E-F)      | 1,298.70 |
| 转入基金 T 日基金份额净值 (H) | 1.500    |
| 转入基金份额 (I=G/H)     | 865.80   |

#### （十四）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 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、司法强制执行和经登记结算机构认可的、符合法律法规的其他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）基金份额持有人可以办理其基金份额在不同交易账户间的转托管手续，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。具体办理方法参照基金管理人及销售机构的业务规则。

（三）登记结算机构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以及经登记结算机构认可的、符合法律法规的其它情况下的冻结与解冻。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）标的指数

##### 1、本基金的标的指数为 iBoxx<sup>®</sup>亚债中国指数。

未来若出现标的指数不符合法律法规及监管的要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

在指数停止编制发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照最近一个交易日的指数信息维持基金投资运作。

本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 2、iBoxx<sup>®</sup>亚债中国指数

指数编制方案请参见本招募说明书附件，投资者可通过以下路径查询指数信息：

<https://ihsmarkit.com/products/iboxx.html>

### （七）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<sup>®1</sup>亚债中国指数。iBoxx<sup>®</sup>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。

### （八）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。

### （九）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。

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

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。

#### （十）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%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

4、基金不得从事卖空。

5、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。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不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

6、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。

7、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%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制。

8、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%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制。

9、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。除第3、5、6项另有约定外，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。

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。

#### （十一）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。

#### （十二）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”的规定。

#### （十三）基金投资组合报告

以下内容摘自本基金 2020 年第 2 季度报告：

##### 5.1 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        | 12,291,218,806.00 | 97.95        |
|    | 其中：债券         | 12,291,218,806.00 | 97.95        |
|    | 资产支持证券        | -                 | -            |
| 3  | 贵金属投资         | -                 | -            |
| 4  | 金融衍生品投资       | -                 | -            |
| 5  | 买入返售金融资产      | 50,000,000.00     | 0.40         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售 | -                 | -            |

|   |              |                   |        |
|---|--------------|-------------------|--------|
|   | 金融资产         |                   |        |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 14,490,521.41     | 0.12   |
| 7 | 其他各项资产       | 192,507,955.82    | 1.53   |
| 8 | 合计           | 12,548,217,283.23 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 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      | 8,840,231,806.00  | 70.48        |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,450,987,000.00  | 27.52        |
|    | 其中：政策性金融债 | 3,450,987,000.00  | 27.52        |
| 4  | 企业债券      | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | -                 | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 12,291,218,806.00 | 98.00        |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称       | 数量(张)     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 190011 | 19 付息国债 11 | 6,900,000 | 696,900,000.00 | 5.56         |
| 2  | 200004 | 20 付息国债    | 6,000,000 | 581,880,000.00 | 4.64         |

|   |        |               |           |                |      |
|---|--------|---------------|-----------|----------------|------|
|   |        | 04            |           |                |      |
| 3 | 190015 | 19 付息国债<br>15 | 5,600,000 | 572,600,000.00 | 4.57 |
| 4 | 190016 | 19 付息国债<br>16 | 5,400,000 | 549,936,000.00 | 4.38 |
| 5 | 190006 | 19 付息国债<br>06 | 5,100,000 | 525,504,000.00 | 4.19 |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | 8,896.62       |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 168,241,105.66 |
| 5  | 应收申购款   | 24,257,953.54  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 192,507,955.82 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

## 十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（一）华夏亚债中国指数（A类）

| 阶段                         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2011年5月25日至<br>2011年12月31日 | 4.50%  | 0.14%     | 4.13%      | 0.11%         | 0.37%  | 0.03% |
| 2012年1月1日至                 | 2.20%  | 0.09%     | 2.42%      | 0.07%         | -0.22% | 0.02% |

|                           |        |       |        |       |        |        |
|---------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2012年12月31日               |        |       |        |       |        |        |
| 2013年1月1日至<br>2013年12月31日 | -3.29% | 0.14% | -2.78% | 0.13% | -0.51% | 0.01%  |
| 2014年1月1日至<br>2014年12月31日 | 11.18% | 0.19% | 11.14% | 0.18% | 0.04%  | 0.01%  |
| 2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 8.26%  | 0.16% | 7.56%  | 0.14% | 0.70%  | 0.02%  |
| 2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 1.24%  | 0.15% | 2.09%  | 0.15% | -0.85% | 0.00%  |
| 2017年1月1日至<br>2017年12月31日 | -2.02% | 0.11% | -2.04% | 0.12% | 0.02%  | -0.01% |
| 2018年1月1日至<br>2018年12月31日 | 9.03%  | 0.12% | 9.04%  | 0.14% | -0.01% | -0.02% |
| 2019年1月1日至<br>2019年12月31日 | 3.94%  | 0.10% | 4.80%  | 0.11% | -0.86% | -0.01% |
| 2020年1月1日至<br>2020年6月30日  | 2.43%  | 0.22% | 2.76%  | 0.22% | -0.33% | 0.00%  |

（二）华夏亚债中国指数（C类）

| 阶段                         | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------------------|--------|---------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 2011年5月25日至<br>2011年12月31日 | 4.30%  | 0.14%         | 4.13%              | 0.11%                 | 0.17%  | 0.03%  |
| 2012年1月1日至<br>2012年12月31日  | 1.73%  | 0.09%         | 2.42%              | 0.07%                 | -0.69% | 0.02%  |
| 2013年1月1日至<br>2013年12月31日  | -3.61% | 0.13%         | -2.78%             | 0.13%                 | -0.83% | 0.00%  |
| 2014年1月1日至<br>2014年12月31日  | 10.79% | 0.19%         | 11.14%             | 0.18%                 | -0.35% | 0.01%  |
| 2015年1月1日至<br>2015年12月31日  | 7.89%  | 0.16%         | 7.56%              | 0.14%                 | 0.33%  | 0.02%  |
| 2016年1月1日至<br>2016年12月31日  | 0.90%  | 0.16%         | 2.09%              | 0.15%                 | -1.19% | 0.01%  |
| 2017年1月1日至<br>2017年12月31日  | -2.33% | 0.11%         | -2.04%             | 0.12%                 | -0.29% | -0.01% |
| 2018年1月1日至<br>2018年12月31日  | 8.62%  | 0.12%         | 9.04%              | 0.14%                 | -0.42% | -0.02% |
| 2019年1月1日至<br>2019年12月31日  | 3.46%  | 0.10%         | 4.80%              | 0.11%                 | -1.34% | -0.01% |
| 2020年1月1日至<br>2020年6月30日   | 2.20%  | 0.22%         | 2.76%              | 0.22%                 | -0.56% | 0.00%  |

## 十二、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。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有资产。

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。

## 十三、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、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

7、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

8、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交易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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值。

6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （七）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，本基金的估值安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （八）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。



## 十四、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、H 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。

### （六）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 十五、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；除法律法规、中国证监会另有规定外，基金合同生效后与基金相关的信息披露费用。
- （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0.13%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.13\% \div \text{当年天数}$$

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<sup>®</sup>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0.05%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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、H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

1、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“（七）申购费与赎回费”与“（八）申购份额与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

2、本基金转换费的费率水平、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“（十三）基金的转换”中的相关规定。

### （三）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

### （四）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照中国内地、香港地区及投资人所在国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十六、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。

## 十七、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。H类基金份额的信息披露人应予披露的基金信息的披露方式详见招募说明书补充文件。

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2.对证券投资业绩进行预测；
- 3.违规承诺收益或者承担损失；
- 4.诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5.登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
- 6.中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1.基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在3个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上。基金招募说明书的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

### 2.基金产品资料概要

基金管理人根据《信息披露办法》的要求公告基金产品资料概要。基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在3个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站上和基金销售机构网站上或营业网点。基金产品资料概要的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金合同终止的，基金管理人可以不再更新基金产品资料概要。

关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，自中国证监会规定之日起开始执行。

3.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。

### 4.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。

### 5.基金净值信息

基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

### 6.基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

7.基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起2个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金合同生效不足2个月的，可不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### 8.临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指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下列事件：

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）《基金合同》终止、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基

金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；

（8）基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

（9）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；

（10）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

（11）基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

（12）基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

（13）基金收益分配事项；

（14）管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（15）基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

（16）基金开始办理申购、赎回；

（17）基金发生巨额赎回并延期办理；

（20）基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（21）基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（22）基金变更标的指数；

（23）本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；

（24）基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

（25）基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 9.澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关



信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### 10.清算报告

基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 11.基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

#### 12.实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 13.中国证监会规定的其他信息

##### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊，本基金只需选择一家报刊。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照《信息披露办法》等相关法律法规的规定和中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

##### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信

息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

（八）法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。

## 十八、侧袋机制

### （一）侧袋机制的实施条件和实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。启用侧袋机制后及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### （二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户各类别份额为基础，确认相应侧袋账户的基金份额持有人名册和份额。

2、对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

3、实施侧袋机制期间，不办理侧袋账户份额的申购、赎回、转换等相关业务；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定的政策办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

4、申购赎回的具体事项安排见基金管理人届时的相关公告。

### （三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

### （四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

#### （五）实施侧袋机制期间基金的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。主袋账户份额满足基金合同分红条款的，可对主袋账户份额进行收益分配。

#### （六）实施侧袋机制期间的基金费用

实施侧袋机制期间，与处置侧袋账户资产相关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，且不得收取管理费。

#### （七）侧袋账户中特定资产的处置清算

特定资产恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### （八）侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露。

（九）法律法规或监管机构、行业协会对侧袋机制另有规定的，从其规定。本招募说明书中关于侧袋机制的内容与届时有效的法律法规、相关规定不一致的，以届时的法律法规、相关规定为准，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十九、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，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

（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、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数编制机构可能停止该指数的服务，从而会对基金投资运作造成不利影响。此外，根据基金合同的约定，出现指数发布机构变更或停止指数发布等情形，基金可能变更标的指数等，从而可能面临标的指数变更等的风险。

## 4、成份券停牌或违约的风险

本基金的标的指数成份券可能出现停牌或违约，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，根据相关规定，本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后可对相关成份券进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

## 5、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。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资者可能面临巨额赎回申请被延期办理、赎回申请被暂停接受、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、基金估值被暂停、基金采用摆动定价等风险。投资者应该了解自身的流动性偏好，并评估是否与本基金的流动性风险匹配。

### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购、赎回与转换”和本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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等。一般情况下本基金拟投资的资产类别具有较好的流动性，但是在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形。本基金管理人将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。同时，本基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

- ①延期办理巨额赎回申请；
- ②暂停接受赎回申请；
- ③延缓支付赎回款项；
- ④摆动定价；
- ⑤中国证监会认定的其他措施。

### （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律

法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险的辅助措施，包括但不限于：

①延期办理巨额赎回申请

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

在此情形下，投资人的全部或部分赎回申请可能将被延期办理，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

②暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“（九）巨额赎回的认定及处理方式”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

③延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购、赎回与转换”中的“（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“（九）巨额赎回的认定及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

④收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

⑤暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“十六、基金财产估值”中的“（六）暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，基金申购赎回申请或被暂停。

⑥摆动定价

当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投

资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

⑦中国证监会认定的其他措施。

#### （5）实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制属于流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回、转换等业务，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项，当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请办理，可能与投资者的预期存在差异，从而影响投资者的投资和资金安排。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

### 6、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。

### 7、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。

根据证券交易资金前端风险控制相关业务规则，中登公司和交易所对交易参与人的证券交易资金进行前端额度控制，由于执行、调整、暂停该控制，或该控制出现异常等，可能影响交易的正常进行或者导致投资者人的利益受到影响。

#### 8、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。

#### 9、H类基金份额的特殊风险揭示详见招募说明书补充文件。

#### （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<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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。

## 二十、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) 按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内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。

## 二十一、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《亚债中国债券指数基金基金合同》。

### “八、基金合同当事人及其权利义务

#### (一) 基金管理人

#### 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) 自行承担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

### 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、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人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。同一类别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权益的活动，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。

## 九、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介公告通知。

## 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介公告。

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）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

- 1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上（含 10%）；
- 2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；
- 3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；
- 4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；
- 5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）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；
- 6、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；
- 7、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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别

由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分相关约定。

（九）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。

（十）香港代表或香港销售机构等相关机构可作为本基金H类基金份额的名义持有人，在符合基金合同的前提下，为H类基金份额持有人行使相关基金份额持有人大会权利提供服务，包括代为要求召开基金份额持有人大会或代为召集基金份额持有人大会；代为出席基金份额持有人大会，代为行使基金份额持有人大会表决权等。

## 二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （二）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。

### （三）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) 按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内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。

## 二十三、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。

#### 二十四、基金合同的效力

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印件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。”

### 二十二、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《亚债中国债券指数基金托管协议》。

#### “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：北京市顺义区安庆大街甲3号院

法定代表人：杨明辉

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：2.38亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：100年

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务。

##### （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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

邮政编码：200120



法定代表人：彭纯

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：742.63亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

### 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（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%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 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、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。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不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- 7、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- 8、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%；但本基金跟

踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制。

9、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%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制。

10、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。除第3、6、7项另有约定外，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。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

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）基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，加强对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面的复核和监督。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

（九）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有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（十）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。

#### 四、基金管理人对于基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本托管协议规定，基金管理人对于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。

## 五、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。

#### 八、基金资产净值计算和会计核算

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净值信息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。

## 十二、基金份额持有人名册的保管

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。

## 十八、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。

## 十六、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （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。”

## 二十三、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）资料发送

#### 1、基金交易对账单

基金管理人根据持有人账户情况定期或不定期发送对账单，但由于基金份额持有人在本公司未详实填写或更新客户资料（含姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致基金管理人无法送出的除外。

#### 2、其他相关的信息资料

指随基金交易对账单不定期发送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、

客户服务问答等。

## （二）电子交易

持有中国建设银行储蓄卡、中国农业银行借记卡、中国工商银行借记卡、中国银行借记卡、招商银行储蓄卡、交通银行太平洋借记卡、兴业银行借记卡、民生银行借记卡、浦发银行借记卡、广发银行借记卡、上海银行借记卡、平安银行借记卡、中国邮政储蓄银行借记卡、华夏银行借记卡等银行卡的个人投资者，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](http://www.ChinaAMC.com)）或本公司移动客户端，与本公司达成电子交易的相关协议，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，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

## （三）电子邮件及短信服务

投资者在申请开立本公司基金账户时如预留准确的电子邮箱地址、手机号码，将不定期通过邮件、短信形式获得市场资讯、产品信息、公司动态等服务提示。

## （四）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热点问题、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 7 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

## （五）在线服务

投资者可通过本公司网站、APP、微信公众号、微官网等渠道获得在线服务。

### 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。

### 2、自助服务

在线客服提供每周 7 天、每天 24 小时的自助服务，投资者可通过在线客服查询最新热点问题、业务规则、基金份额净值等信息。

### 3、人工服务

周一至周五的在线客服人工服务时间为 8:30~21:00，周六至周日的在线客服人工服务时间为 8:30~17:00，法定节假日除外。

#### 4、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](http://www.ChinaAMC.com)

电子信箱：[service@ChinaAMC.com](mailto:service@ChinaAMC.com)

#### （六）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。

## 二十四、其他应披露事项

（一）2020年10月15日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二）2020年10月21日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（三）2020年10月22日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（四）2020年10月24日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（五）2020年10月27日发布亚债中国债券指数基金2020年第3季度报告。

（六）2020年11月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（七）2020年11月6日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（八）2020年11月25日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（九）2020年12月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

公告。

（十）2020年12月11日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（十一）2020年12月14日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（十二）2020年12月19日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告。

（十三）2020年12月21日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（十四）2021年1月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（十五）2021年1月9日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（十六）2021年1月15日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（十七）2021年1月20日发布华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告。

（十八）2021年1月21日发布亚债中国债券指数基金2020年第4季度报告。

（十九）2021年1月27日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十）2021年1月29日发布华夏基金管理有限公司关于调整亚债中国债券指数基金基金经理的公告。

（二十一）2021年2月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十二）2021年2月24日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十三）2021年3月12日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十四）2021年3月29日发布华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引》修订旗下部分公募基金基金合同的公告。

（二十五）2021年3月30日发布亚债中国债券指数基金2020年年度报告。

（二十六）2021年4月2日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十七）2021年4月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十八）2021年4月9日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（二十九）2021年4月21日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

（三十）2021年4月21日发布亚债中国债券指数基金2021年第1季度报告。

（三十一）2021年4月28日发布华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修订旗下部分公募基金基金合同的公告。

## 二十五、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。

## 二十六、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和/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  
二〇二一年四月二十八日

## 附件一：标的指数编制方案

（最新的指数编制方案可登录指数公司网站查询）

### 1、Markit iBoxx 亚债基金中国指数

Markit iBoxx 亚债基金中国指数(iBoxx ABF 中国指数)旨在反映中国在岸市场以人民币计价的主权和次主权债务的表现，同时维持指数最优的可投资性和流动性。这个指数是 Markit iBoxx 全球指数系列的组成部分，为市场提供准确客观的业绩比较基准用以评估债券市场和投资表现。

所有 iBoxx 指数（包括 iBoxx ABF 中国指数）计算所采用的债券价格均基于多价格数据来源。相关价格数据来源介绍请查阅 [www.ihsmarket.com](http://www.ihsmarket.com) 公布的“Markit iBoxx Pricing Rules”文件。

另外，指数编制规则及其应用将由 iBoxx 亚洲监督委员会协助指导。本文档主要涵盖了指数系列的架构，编制规则和计算方法。

#### 1.1 iBoxx 亚洲监督委员会

为了确保 iBoxx ABF 中国指数的独立性和客观性，iBoxx 亚洲监督委员会协助指导指数编制规则和合规性以确保其与主要 iBoxx 指数系列架构保持一致。

监督委员会由资产管理公司，顾问咨询公司，行业机构和监管机构的人员代表组成。该委员会主要职责是审查和讨论 IHS Markit 给出的提议，并就可能需要因市场发展而更改指数编制规则提供咨询意见。

#### 1.2 指数公布

对于所有指数，日终点位在每天市场交易结束后计算并发布一次。除所有亚洲市场公共假期外，每天都会计算指数日终点位。此外，如果每月的最后一个日历日不是交易日，则该指数是根据每个月的最后一个日历日的前一个交易日的收盘价计算。IHS Markit 会发布指数计算日历，该日历可在 [www.ihsmarket.com](http://www.ihsmarket.com) 网站“Calendar”下面的“indices”部分中获取。iBoxx ABF 中国指数计算遵循亚洲假期日历时间表。

债券和指数的分析数据将会根据债券每日收盘价在每个交易日计算出来。指数日终点位和主要分析数据将在每个工作日结束后在 [www.ihsmarket.com](http://www.ihsmarket.com) 网站的“indices”部分中为数据认购客户发布。

指数数据也可以从主要信息提供商渠道获得，主要信息提供商包括 Bloomberg 和

Thomson Reuters 等。

## 2、债券选择规则

以下条件用于 iBoxx ABF 中国指数成分的选取：

- 债券类型
- 债券发行人类型
- 债券发行人所在地
- 债券主体国际评级
- 债券发行时期限
- 债券剩余期限
- 债券流通存量

### 2.1 债券类型

符合以下债券种类将被纳入指数：

- 固定票率和零息债券
- 复合息票和递增息票债券
- 有固定偿债计划的分期还本债券

以下债券种类将从指数中排除：

- 可赎回及可回售债券
- 浮动利率票据和其他固定转浮动债券
- 认股权证债券
- 可转债
- 无期限债券
- 通胀和其他指数挂钩和信用挂钩债券
- 零售债券-零售债券清单每月更新一次，并发布在 [www.ihsmarket.com](http://www.ihsmarket.com) 网站“Indices

News”部分中

- 私募债-私募债清单每月更新一次，并发布在 [www.ihsmarket.com](http://www.ihsmarket.com) 网站“Indices News”

部分中

- 抵押债券

对于零售债券和私募债，公开信息并非总是具备结论性。IHS Markit 将根据可用的信息自行决定相关债券分类为零售债券还是私募债。IHS Markit 亦可以咨询监督委员会以审查相关债券分类结果。



任何分类为零售或私募的债券都将添加到私募和零售债券排除列表中。该列表发布在 [www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com) 网站“Indices News”部分中，以备将来参考并确保决策的一致性。

如果根据发布的指数规则未明确排除或包括新债券类型，IHS Markit 将根据本指引 2.1 中列出的原则分析此类证券的特征。IHS Markit 可以咨询特定的指数咨询委员会。并将发布有关新债券是否具备指数纳入资格的决定，且相应的更新指数规则。

以一种货币计价但以不同货币支付息票或本金的债券将不具备纳入指数的资格。

## 2.2 债券发行人类型

只有主权债券和次主权债券才有资格被纳入该指数。中国准主权债券中有政策性银行以及中央政府支持机构被视为准主权债券。无论中央政府还是地方政府所有的国有企业(SOE)均不被纳入该指数中。

## 2.3 债券发行人所在地

除国际机构外，所有发行人（或金融子公司的担保人）都必须注册在以下 ABF 的国家地区境内：

- 中国大陆
- 香港特别行政区
- 印度尼西亚
- 韩国
- 马来西亚
- 菲律宾
- 新加坡
- 泰国

## 2.4 债券主体国际评级

中国国债不需要评级。为了确保该指数具有较高的信用质量，大多数准政府债券需要被评为投资等级。计算 iBoxx 信用评级时，将参考以下三个信用评级机构的评级：

- Fitch Ratings
- Moody's Investor Service
- S&P Global Ratings

Fitch Ratings 和 S&P Global Ratings 将投资等级定为 BBB-或更高。Moody's Investor Service 将投资等级定为 Baa3 或更高。

如果债券被以上多家机构进行评级，则 iBoxx 信用评级选取所有机构评级结果合并到最

接近的等级取平均值。评级缺口将不被使用。请参阅“iBoxx 评分规则”以获取如何确定 iBoxx 信用评级更多信息。该评分规则可以在 [www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com) 网站“Methodology”部分找到。

2006 年 9 月 30 日之前所使用 iBoxx 评级是最低的评级。2006 年 9 月 30 日到 2007 年 6 月 30 日之间的过渡时期仍然使用最低评级来决定债券是否为投资级。

国际机构债券至少需要 AA-级。

投资级市场中的无评级债券或发行人只有在满足以下准政府类别才有资格被纳入到指数中：

- 具有中央政府担保
- 可以确定发行人与中央政府有紧密的联系并得到中央政府支持的金融机构(例如：降低风险权重以计算商业银行的资本充足率，或者高级政府代表在公司董事会中任职等)。

是否包含未评级的金融机构的决定将视具体情况而定。

次投资级市场的准主权债如果没有投资级评级都将会从指数中剔除。可适用的主权债务评级是 Fitch, Moody's 和 Standard&Poor's 本地货币债务评级中的最佳评级。

## 2.5 债券发行时期限

所有债券发行时的最短债券期限必须为 18 个月。最短期限是从债券的第一个结算日起至到期日，并四舍五入至最接近的月份。

## 2.6 债券剩余期限

所有指数成分债券在任何指数调整日都必须具有至少一年的剩余期限。债券剩余期限从债券的调整日到最终到期日而计算的。

对于分期还本债券，将使用平均寿命而不是最后偿还期来计算剩余期限。

## 2.7 债券流通存量

下表显示了债券的最低流通存量要求：

| 市场 | 货币  | 主权债            | 准主权债           |
|----|-----|----------------|----------------|
| 中国 | 人民币 | 20,000,000,000 | 10,000,000,000 |

## 2.8 准主权发行人的发行数量限制

主权债的发行数量没有限制。为了提高指数的可投资性并保持发行人的高度分散性，每个准主权发行人（由彭博代码确定）的发行数量限制为每种货币 5 只债券。如果有五种以上以相同货币计价的债券有资格被纳入指数，则使用流动性排名来确定哪些债券具有更大的流动性，从而决定将哪些债券包括在指数中。流动性排名基于以下四个因素：

- 流通存量
- 年限(自发行日起)
- 剩余期限
- 现有指数成分债券

Z 分数用于确定债券与来自同一发行人的其他债券的相对流动性每个发行主体的每只债券以及每个因子都将计算一个 z 分数。

债券流通存量、剩余期限和年限采用同样的计算方法。债券剩余期限和年限按照各章中的描述的方法进行计算。

现有指数成分债券-现有指数成分债券会分配 10% 因子以降低指数调整周转率。现有指数成分分配的分是 1，而潜在纳入的新成分所分配的分是 0。

综合的 z 分数权重为：

- 流通存量 0.5
- 年限(短期的流动性更好)-0.2
- 单一债券的剩余期限 0.2
- 现有指数成分债券 0.1

单一债券的综合排名因子是通过将三个 z 分数相加并加权而确定的：

$$z_i^* = 0.5z_i(\text{AO}) + 0.2z_i(\text{TMM}) - 0.2z_i(\text{Age}) + 0.1(\text{EC})$$

其中：

$z_i(\text{Age})$ —债券 i 的年限 z 分数

$z_i(\text{AO})$ —债券 i 的流通存量 z 分数

$z_i(\text{TMM})$ —债券 i 的剩余期限 z 分数

EC—现有指数成分债券

每个发行人的综合 z 分数排名前五的债券将被纳入到指数中。

### 3、指数详细信息

#### 3.1 指数调整

iBoxx ABF 中国指数在每个月最后一个日历日市场交易结束后进行指数调整。静态数据（例如评级，债券发行量等）仅在截止月底前三个工作日公开发布变更才会处理。评级，债券发行量等的改变发生在该月最后两个交易日内的将在下一次指数调整中进行处理。新发行的债券必须在月底前结算，并且所有相关信息必须在月底前至少三个交易日公布。

指数初始成分列表会在每个月月底前四个工作日在 FTP 服务器上以及 [www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com)

网站上“indices”部分的“Data”->“Bond List Preview”中为指数认购用户发布

包含债券未偿还最终金额的成分名单将在每个月底三个工作日之前发布。此列表代表指数下个月的成分债。

在每个月的最后一个工作日，IHS Markit 会发布指数最终成分名单，包括债券的收盘价，以及基于债券价格的各种债券分析数据。

### 3.2 指数历史数据

该指数历史数据始于 2000 年 12 月 31 日，于 2004 年 12 月 31 日的点位为 100。

### 3.3 结算日惯例

所有 iBoxx 亚债基金指数计算都假设指数成分债券于 T+0 为结算。

### 3.4 数据发布与获取

请参考以下列表。iBoxx 亚债基金指数数据在 IHS Markit 网站 [www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com) 网站“Indices”部分公布，以及通过 FTP 服务器向指数认购用户发布。

| Frequency      | FileType                   | Access   |
|----------------|----------------------------|--|
| Daily          | Underlying file–Bond level | FTP Server   |
|                | Indices files–Index level  | FTP Server/IHS Markit website/Bloomberg(index levels only) |
| Weekly         | Preview components         | FTP Server/IHS Markit website                              |
| Daily from T+1 | Forwards                   | FTP Server   |
| Monthly        | End of month components    | FTP Server/IHS Markit website                              |
|                | XREF files                 | FTP Server   |

### 3.5 指数修改

指数的修改按照 iBoxx Index Restatement Policy 中公布的政策执行。此文件可以在 [www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com) 网站上“Methodology”部分获取。

### 3.6 指数审查

指数的编制规则每年会在年度指数审查过程中进行调整以确保指数能够均衡地代表所覆盖的本币债市场经济体。年度指数审查会议结束后会立即将审查结果公布在 [www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com) 网站上 Indices News 部分中。

## 4、其它信息

### 关键术语表

Markit iBoxx Glossary文件可在[www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com)网站上iBoxx Documentation网页中的Methodology部分获取。

### **许可牌照和数据**

iBoxx是Markit Indices GmbH的注册商标。Markit Indices GmbH拥有所有iBoxx数据，数据库，指数和所有知识产权。创建和/或发布使用基于或引用任何iBoxx指数或iBoxx数据的任何产品需要事先向Markit Indices GmbH获取许可牌照。

### **所有权**

Markit Indices GmbH是IHS Markit Limited的全资子公司