

华夏上证基准做市公司债交易型开放式指数证券
投资基金基金份额发售公告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

目录

重要提示.....	1
一、本次发售基本情况.....	4
二、投资者开户.....	9
三、网上现金认购的程序.....	9
四、网下现金认购的程序.....	9
五、网下债券认购的程序.....	12
六、清算与交割.....	13
七、基金的验资与基金合同生效.....	14
八、本次发售当事人或中介机构.....	15
九、网下债券认购清单.....	19

重要提示

1、华夏上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证监会 2024 年 12 月 31 日证监许可[2024]1967 号文准予注册。

2、本基金为债券型 ETF 基金。

3、本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为兴业银行股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、目前投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购 3 种方式认购本基金，如调整认购方式，本公司将另行公告。本基金基金份额初始面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

网上现金认购是指投资者通过发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。网下债券认购是指投资人通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构以债券进行的认购。

6、本基金自 2025 年 1 月 7 日起至 2025 年 1 月 13 日（含当日）进行发售。具体业务办理时间遵循发售机构的相关规定。基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。本公司可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。基金管理人可适当调整发售期并公告。

7、投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所 A 股账户或基金账户。上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资者已提交的身份证件或身份证明文件如已过有效期，请及时办理相关更新手续，以免影响认购。投资者在认购时还应遵守销售机构有关反洗钱的相关要求，配合提供必要的客户身份信息与资料。

8、投资者在基金管理人直销机构办理网下现金认购和网下债券认购时需缴纳认购费。

发售代理机构办理网上现金认购、网下现金、网下债券认购时可参照规定费率结构收取一定的认购费用/佣金。

9、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资人可以多次认购，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资人可以多次认购，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

网下债券认购以单只债券手数申报，投资者应以A股账户认购。用于认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券，具体名单以基金份额发售公告为准。单只债券最低认购申报手数为1手（人民币1000元面值债券为1手），超过1手部分须为1手的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

10、本基金可设置首次募集规模上限。本基金首次募集规模上限为人民币30亿元（不含募集期利息）。

11、基金份额发售机构（发售代理机构和/或直销机构）受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以登记机构的确认为准。投资者应主动在本基金合同生效后到其办理认购业务的销售网点查询认购确认情况，基金管理人及发售代理机构不承担对确认结果的通知义务。

12、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读《华夏上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要及本公告将同时发布在本公司网站（www.ChinaAMC.com）。投资者如有疑问，可拨打本公司客户服务电话（400-818-6666）及各发售代理机构客户服务电话。

13、风险提示

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连续大量赎回基金产生的流动性风险，基

基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险。此外，本基金作为交易型开放式指数证券投资基金，还将面临该类基金的特有风险。本基金属于债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金采用抽样复制策略跟踪标的指数，由于基金费用、交易成本、组合持仓与标的指数成份券之间存在差异、基金估值方法与指数成份券取价规则之间存在差异等因素，可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。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。

本基金可投资于国债期货，可能面临的风险包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。本基金可投资于资产支持证券，可能面临的风险包括流动性风险、证券提前赎回风险、再投资风险、SPV违约风险等。

具体风险揭示详见本基金招募说明书。

投资者应当认真阅读并完全理解基金合同第二十二部分规定的免责条款、第二十三部分规定的争议处理方式。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，基金运营状况、基金份额上市交易价格波动与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。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，在了解产品情况、听取销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

14、本基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次发售基本情况

（一）基金的基本情况

基金名称：华夏上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：华夏上证基准做市公司债ETF

场内简称：信用债基

扩位简称：信用债 ETF 基金

网上现金、网下现金认购、网下债券认购代码：511203

（二）基金运作方式和类别

基金的运作方式：交易型开放式

基金的类别：债券型证券投资基金

（三）存续期限

存续期限：不定期。

（四）基金份额面值

每份基金份额初始面值为 1.00 元人民币，认购价格为 1.00 元。

（五）发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（六）募集规模上限及控制方案

本基金首次募集规模上限为人民币 30 亿元（不含募集期利息）。

募集结束后，若本基金募集期内的有效认购申请全部确认后不超过人民币 30 亿元，则投资者在募集期内提交的有效认购申请全部予以确认。

募集结束后，若本基金募集期内的有效认购申请全部确认后超过人民币 30 亿元，将对募集期内的有效认购申请采用“全程比例确认”的原则给予部分确认，未确认部分将在募集期结束后退还给投资者。当发生比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况和结果。

认购申请确认比例的计算方法如下（不含募集期利息）：

有效认购申请确认比例=30 亿份/有效认购申请份额总额

投资者有效认购申请确认份额=提交的有效认购申请份额×认购申请确认比例

当发生部分确认时，本基金登记结算机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期每笔有效认购申请份额进行部分确认处理，因对每笔认购明细处理的精度等原因，最终确认的

本基金的有效认购份额（不含募集期利息）可能会略微高于或低于 30 亿份。最终投资者有效认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记结算机构的计算并确认的结果为准。

基金管理人可对募集规模相关事项进行调整，具体详见届时发布的相关公告。

（七）基金份额发售机构

1、发售协调人：中信证券股份有限公司。

2、网上现金认购发售代理机构：网上现金认购发售代理机构为具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

3、网下现金、网下债券认购发售直销机构：华夏基金管理有限公司

4、网下现金、网下债券认购发售代理机构：详见本公告“八（三）4、网下现金、网下债券发售代理机构”及基金管理人后续发布的调整发售机构的相关公告或基金管理人网站公示。

（八）发售时间安排

本基金自 2025 年 1 月 7 日起至 2025 年 1 月 13 日（含当日）发售。具体业务办理时间见本发售公告，发售机构具体业务办理时间遵循其各自规定。如果在发售期间未达到本基金招募说明书规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。基金管理人可适当调整发售期并公告。

（九）发售方式及相关规定

1、目前投资者可选择网上现金认购、网下现金、网下债券认购 3 种方式认购本基金。如调整认购方式，本公司将另行公告。

2、募集期内，本基金在基金管理人及发售代理机构办理基金认购业务的营业场所或按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金的认购。

3、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资人可以多次认购，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

4、网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资人可以多次认购，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

5、网下债券认购以单只债券手数申报，投资者应以A股账户认购。用于认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券，具体名单以基金份额发售公告为准。单只债券最低认购申报手数为1手（人民币1000元面值债券为1手），超过1手的部分须为1手的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

（十）认购费用

认购费用由投资者承担，具体的认购费率如下：

认购份额（M）	认购费率
M < 50 万份	0.40%
50 万份 ≤ M < 100 万份	0.20%
M ≥ 100 万份	1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下债券认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的认购费用/佣金。

2、认购费用计算公式和收取方式

本基金基金份额初始面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

（1）通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算公式为：

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{佣金比率})$$

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例一：某投资者到某发售代理机构网点认购10,000份本基金基金份额（认购价格为1.00元），假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.40%，则需准备的认购资金金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 10,000 \times 0.40\% = 40.00 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 10,000 \times (1 + 0.40\%) = 10,040.00 \text{元}$$

即该投资者若通过该发售机构认购本基金10,000份，需准备10,040.00元资金，一共可以得到10,000份基金份额。

(2) 通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

(或若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

(或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

例二：某位投资者到基金管理人直销网点认购50万份本基金基金份额（认购价格为1.00元），认购产生的利息为50元，则需准备的资金金额和募集期间利息折算的份额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 500,000 \times 0.2\% = 1,000.00 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 500,000 \times (1 + 0.2\%) = 501,000.00 \text{元}$$

$$\text{利息折算份额} = 50.00 / 1.00 = 50 \text{份}$$

即投资者若通过基金管理人直销网点认购本基金50万份，需准备501,000元资金，假定该笔认购金额产生利息为50元，则投资人可得到500,050份本基金基金份额。

(3) 通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

(4) 网下债券认购以单只债券手数申报，投资者应以A股账户认购。用于认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券，具体名单以基金份额发售公告及后续相关公告为准。认购份额的计算公式为：

$$\text{投资者的认购份额} = \sum_i (\text{第 } i \text{ 只债券的价值} \times \text{有效认购数量}) / \text{基金份额面值}$$

其中：

1) i 代表投资人提交认购申请的第 i 只债券，如投资人仅提交了 1 只债券的申请，则 $i = 1$ ；

2) T 日为网下债券认购期的最后一日；

3) D 日为债券过户日；

4) “第 i 只债券的价值”=第 i 只债券在 T 日的第三方估值机构估值价（注：如无特别所指，则为估值净价）+截至 $(D-1)$ 日应计利息。

具体规定见本基金招募说明书。

在发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。

(1) 若投资人选择以现金方式支付认购佣金，则其可得到的净认购份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

(或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额}$$

(2) 若投资人选择以基金份额的方式支付认购佣金，则其可得到的净认购份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} / (1 + \text{佣金比率}) \times \text{佣金比率}$$

(或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购佣金} / \text{认购价格}$$

以基金份额方式支付佣金的认购佣金的计算采用截位法保留至整数位。

例三：某投资人持有本基金标的指数成份券中债券A500手，至某发售代理机构网点认购本基金，选择以现金方式支付认购佣金。假设网下债券认购期最后一日债券A的估值价为100.50元。基金管理人确认的有效认购数量为500手债券A，发售代理机构确认的认购费率为0.2%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购份额} = (500 \times 10 \times 100.50) / 1.00 = 502,500 \text{份}$$

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 502,500 \times 0.2\% = 1,005 \text{元}$$

即投资人可认购到502,500份本基金基金份额，并需另行支付1,005元的认购佣金。

例四：某投资人持有本基金标的指数成份券中债券A500手，至某发售代理机构网点认购本基金，选择以基金份额的方式支付认购佣金。假设网下债券认购期最后一日债券A的估值价为100.50元。基金管理人确认的有效认购数量为500手债券A，发售代理机构确认的认购费率为0.2%，则其最终可得到的净认购份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购份额} = (500 \times 10 \times 100.50) / 1.00 = 502,500 \text{份}$$

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 502,500 / (1 + 0.2\%) \times 0.2\% = 1002 \text{元}$$

$$\text{净认购份额} = 502,500 - 1002 / 1.00 = 501,498 \text{份}$$

即投资者可认购到501,498份本基金基金份额，并由基金管理人为发售代理机构增加1002份基金份额。

二、投资者开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。

(一) 投资者认购开户应注意：

1、如投资者需新开立证券账户，则应注意：

(1) 上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户。

(2) 开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2、如投资者已开立证券账户，则应注意：

(1) 如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

(2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

三、网上现金认购的程序

(一) 业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月13日（含当日）的9：30~11：30和13：00~15：00（周六、周日及法定节假日不受理）。

(二) 认购手续：

1、开立上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户，办理指定交易或转指定交易。

2、按发售代理机构的规定，在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3、投资者网上现金认购流程、需提交的文件等应遵循发售代理机构及上海证券交易所的有关规定。

四、网下现金认购的程序

(一) 直销机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月13日（含当日）的8：30~17：00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、个人投资者在本公司的直销机构办理基金的认购手续时需提供下列资料：

- (1) 投资者本人签字的有效身份证件复印件。
- (2) 投资者本人签字的上海证券交易所 A 股账户卡复印件或基金账户卡复印件。
- (3) 盖银行受理章的汇款凭证复印件。
- (4) 填妥的《华夏基金网下现金、股票/债券认购业务申请表》。(此申请表电子版与纸质盖章版均需提供)。
- (5) 本公司直销机构要求提供的其他有关材料。

3、机构投资者在本公司直销机构办理基金的认购手续时需提供下列资料：

- (1) 填妥的《华夏基金网下现金、股票/债券认购业务申请表》。(此申请表电子版与纸质盖章版均需提供)
- (2) 上海证券交易所 A 股账户卡复印件或基金账户卡复印件。
- (3) 基金业务授权委托书。
- (4) 业务经办人有效身份证复印件。
- (5) 加盖银行受理印章的汇款凭证复印件。
- (6) 提供加盖单位公章的营业执照复印件(未换发三证合一营业执照的需同时提供加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件)。
- (7) 本公司直销机构要求提供的其他有关材料。

4、募集期间，投资者将足额认购资金汇入本公司指定的以下任一直销资金专户：

(1) 兴业银行账户

户名：华夏基金管理有限公司

账号：326660100100373856

开户银行名称：兴业银行北京分行营业部

(2) 交通银行账户

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：110060149018000349649

开户银行名称：交通银行北京分行营业部

(3) 中国建设银行账户

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：11001046500056001600

开户银行名称：中国建设银行北京复兴支行

(4) 中国工商银行账户

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：0200250119000000892

开户银行名称：中国工商银行北京复兴门支行

(5) 招商银行账户

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：866589001110001

开户银行名称：招商银行北京分行金融街支行

(6) 中国银行账户

户名：华夏基金管理有限公司

账号：660074740743

开户银行名称：中国银行广州越秀支行营业部

5、注意事项：

(1) 投资者在认购时不能使用华夏基金管理有限公司基金账户卡，而需使用上海证券交易所 A 股账户卡或基金账户卡。

(2) 若投资者的认购资金在认购申请当日 17:00 之前未到达本公司指定的直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准。在本基金发行截止日的 17:00 之前，若投资者的认购资金未到达本公司指定账户，则投资者提交的认购申请将可被认定为无效认购。

(3) 投资者在汇款时备注字段填写“华夏上证基准做市公司债 ETF 网下现金认购”字样，避免与其他正常申购资金混淆。

(二) 发售代理机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月13日（含当日），具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2、认购手续：

(1) 开立上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户，办理指定交易或转指定交易。

(2) 按发售代理机构的规定，在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。具体办理流程及需要提交的文件等应遵循发售代理机构的相关规定。

五、网下债券认购的程序

（一）直销机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月13日（含当日）9：30~11：30和13：00~17：00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、个人投资者在本公司直销机构办理网下债券认购所需资料如下：

（1）填妥的《华夏基金网下现金、股票/债券认购业务申请表》。（此申请表电子版与纸质盖章版均需提供）

（2）投资者本人签字的上海证券交易所A股账户卡复印件。

（3）投资者本人签字的有效身份证件复印件。

（4）本公司直销机构要求提供的其他有关材料。

3、机构投资者在本公司直销机构办理网下债券认购所需资料如下：

（1）填妥的《华夏基金网下现金、股票/债券认购业务申请表》。（此申请表电子版与纸质盖章版均需提供）

（2）上海证券交易所A股账户卡复印件。

（3）基金业务授权委托书。

（4）业务经办人有效身份证复印件。

（5）提供加盖单位公章的营业执照复印件（未换发三证合一营业执照的需同时提供加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件）。

（6）提供加盖单位公章的债券份额承诺书。

（7）本公司直销机构要求提供的其他有关材料。

4、直销机构办理网下债券认购的程序：

（1）开立上海证券交易所A股账户。

如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金标的指数成份券或已公告的备选成份券进行网下债券认购的，应开立并使用上海A股账户。

（2）在A股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份券或备选成份券。

（3）投资者准备相关资料并填写认购委托单。登记机构将在募集结束后办理用以认购的债券的冻结业务，届时如投资者用以认购的债券的可用数量不足，则投资者的该笔债券认购申请无效。

具体认购程序以本公司直销机构的规定为准。

(二) 发售代理机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月13日（含当日），具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

2、办理网下债券认购的程序：

(1) 开立上海证券交易所A股账户。

如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金标的指数成份券或已公告的备选成份券进行网下债券认购的，应开立并使用上海A股账户。

(2) 在A股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份券或备选成份券。

(3) 投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购债券即被冻结。

具体认购程序以发售代理机构的规定为准。

(三) 特别提示：

1、开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

六、清算与交割

(一) 网上现金认购的清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的4个工作日内将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

(二) 网下现金认购的清算交收：通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。现金认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

(三) 网下债券认购的清算交收：T日日终（T日为本基金发售期最后一日），发售代理

机构将债券认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人,基金管理人初步确认各成份债券的有效认购数量。T+1日起,登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者有效认购申请相应的债券进行冻结。以基金份额方式支付佣金的,基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金,并从投资者的认购份额中扣除,为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的有效认购申请债券数据,将投资者有效认购申请相应的债券过户至本基金的证券账户。基金合同生效后,登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

(四) 通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额归投资者所有,其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准;网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后产生的利息,计入基金资产,不折算为投资者基金份额。投资人以债券认购的,认购债券由登记机构予以冻结,冻结期间产生的权益根据中国证券登记结算有限责任公司的业务规则进行处理。

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

(六) 登记机构在发售结束后完成过户登记。

七、基金的验资与基金合同生效

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额不少于 2 亿元人民币(含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值)且基金认购人数不少于 200 人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在 10 日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会办理基金备案手续。

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券,登记机构应予以解冻,登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。
- 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、

基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

八、本次发售当事人或中介机构

（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

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：张佑君

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：邱曦

网址：www.ChinaAMC.com

（二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼

法定代表人：吕家进

资产托管部信息披露负责人：龚小武

电话：021-52629999-212056

传真：021-62159217

客服电话：95561

网址：<https://www.cib.com.cn/cn/>

（三）销售机构

1、发售协调人

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

2、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

3、网下现金、网下债券发售直销机构

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

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：张德根

网址：www.ChinaAMC.com

募集期间，投资者可以通过本公司北京分公司，设在北京的投资理财中心进行网下现金、网下债券认购。

（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）北京西三环投资理财中心

地址：北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼一层107-108A（100089）

电话：010-82523198

传真：010-82523196

（3）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

（4）北京朝阳投资理财中心

地址：北京市朝阳区朝阳门兆泰国际AB座2层（100020）

电话：010- 64185185

传真：010- 64185180

4、网下现金、网下债券发售代理机构

（1）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

（2）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：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：肖海峰

电话：0532-85725062

传真：0532-85022605

联系人：赵如意

网址：sd.citics.com/

客户服务电话：95548

（3）中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01号）1001室（部位：自编01号）

办公地址：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01号）1001室（部位：自编01号）

法定代表人：陈可可

电话：020-88834780

传真：020-88836914

联系人：郭杏燕

网址：www.gzs.com.cn

客户服务电话：95548

本公司可以根据情况变化调整网下现金及网下债券发售机构，投资者可登录本公司官网查询。各销售机构具体业务办理情况以其各自规定为准。

（四）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

（五）律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

联系电话：021- 51150298

传真：021- 51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、黄丽华

（六）会计师事务所

本公司聘请的法定验资机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

法定代表人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：蒋燕华

九、网下债券认购清单

本基金募集期间，网下债券认购名单如下表所示。基金管理人可根据个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常或基金管理人认为对基金资产可能产生不利影响的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

证券代码	证券简称	证券代码	证券简称	证券代码	证券简称
115039	23 诚通 01	240703	24 长电 K1	241328	24 吉高 02
115169	23 光明 01	240707	24 通用 01	241332	24 恒健 05
115323	23 北控 K1	240729	24 首钢 02	241335	24 赣投 K2
115432	23 中交 K1	240784	24 葛洲 K1	241343	24 国新 01
115442	23 广越 05	240785	24 鲁金 K1	241348	24 中交 K3
115559	23 赣交 K2	240803	24 兵器 K1	241356	24 紫金 K2
115682	23 京资 02	240889	24 八局 K1	241379	24 兖矿 K3
115717	23 吉高 02	240908	24 首集 K2	241395	24 赣交 K1
115838	23 三峡 K2	240918	24 焦煤 K1	241472	24 中化 12
115886	23 吉利 K1	240924	24 中化 04	241486	24 赣交 K2
115904	23 渝富 03	240927	24 焦煤 K2	241522	24 京投 K6
115933	23 兵器 K1	240949	24 国机 K1	241549	24 华电 K4
122175	12 中交 03	240950	24CHNG2K	241551	建材集 K1
136165	16 中油 02	240958	24 通用 02	241572	24 兵器 K2
136849	16 华能债	240996	24 紫金 K1	241598	24 中化 K1
143798	18 华能 03	241013	24CHNG3K	241611	24 中信 04
163112	20 金隅 02	241026	24 国药 01	241629	24 铁工 K5
175953	21 诚通 03	241032	24 铁工 K2	241636	24 兖矿 K4
188379	21 诚通 09	241054	GK 国能 01	241638	24 赣交 K3
240046	23 皖交 05	241092	24 铁工 K3	241674	24 京能 K1
240085	23 山能 K2	241105	24 陕煤 K2	241676	24 铁工 K7
240122	23 延长 K7	241135	24 中化 08	241725	24 电建 K2
240213	23 鲁高 K2	241147	24CMGK01	241794	24 赣交 K4
240312	23 财金 03	241154	24 广越 05	241826	24 国投 08
240359	GC 三峡 K2	241166	GK 国能 02	241837	24 京投 K7
240449	24 吉高 01	241186	24 财金 05	241872	24 鲁高 K4
240550	24 宝武 K1	241220	GC 三峡 K4	241875	建材 K9
240573	24 电建 K1	241226	24 京投 K3	241884	24 中化 16
240582	24 兖矿 K1	241248	24 中化 10	241960	24 中机 K1
240590	24 首集 K1	241278	24 恒健 03	241975	24 电建 K4

华夏上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

240618	24CHNG1K	241279	24 恒健 04	242049	24 京投 K8
240662	24 中化 02	241318	24 中煤 K2	242165	24 延长 K1

华夏基金管理有限公司

二〇二五年一月三日