# 华夏基金管理有限公司关于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上市交易公告书提示性公告

华夏基金管理有限公司(以下简称"本公司")董事会及董事保证基金上市交易公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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,交易代码:511200)将于2025年2月7日在上海证券交易所上市,上市交易公告书全文于2025年1月27日在本公司网站(www.ChinaAMC.com)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)披露,供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话(400-818-6666)咨询。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征,审慎做出投资决定。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇二五年一月二十七日

# 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开放日常申购、赎回业务公告

公告送出日期:2025年1月27日

1 公告基本信息

| | |
|---|---|
| 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 |
| 基金主代码 | 511200 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025年1月16日 |
| 基金管理人名称 | 华夏基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 兴业银行股份有限公司 |
| 基金注册登记机构名称 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 公告依据 | 《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《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合同》《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》 |
| 申购起始日 | 2025年2月7日 |
| 赎回起始日 | 2025年2月7日 |

注:场内简称:信用债基,扩位证券简称:信用债ETF基金。

2 日常申购、赎回业务的办理时间

投资人在开放日办理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")基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或实际情况需要,基金管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《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》")的有关规定在规定媒介上公告。

3 日常申购、赎回业务

3.1 申购与赎回的原则

1、基金采用"份额申购、份额赎回"原则,即申购、赎回均以份额申请。

2、基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定。

5、未来,在条件允许的情况下基金管理人可以调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成。

6、基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3.2 申购和赎回的数额限制

1、投资者申购、赎回的基金份额需为基金最小申购、赎回单位的整数倍。目前,本基金最小申购、赎回单位为2000份。基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资需求等因素对基金的最小申购、赎回单位进行调整并提前公告。

2、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数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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制,具体见基金管理人相关公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可设定申购份额上限和赎回份额上限,以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制,并在申购赎回清单中公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3.3 申购与赎回的对价和费用

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时,基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来,若市场情况发生变化,或相关业务规则发生变化,基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

3、投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

若市场情况发生变化,或相关业务规则发生变化,基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,履行相关程序后,对基金申购赎回业务规则、基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间等进行调整并提前公告,无须召开基金份额持有人大会。

4 申购赎回代办证券公司

| 销售机构名称 | | 网址 | 客户服务电话 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中信建投证券股份有限公司 | www.csc108.com | 95587、4008-888-108 |
| 2 | 国信证券股份有限公司 | www.guosen.com.cn | 95536 |
| 3 | 招商证券股份有限公司 | www.cmschina.com | 95565 |
| 4 | 广发证券股份有限公司 | www.gf.com.cn | 95575 |
| 5 | 中信证券股份有限公司 | www.cs.ecitic.com | 95548 |
| 6 | 中国银河证券股份有限公司 | www.chinastock.com.cn | 4008-888-888或95551 |
| 7 | 海通证券股份有限公司 | www.htsec.com | 95553、400-888-8001 |
| 8 | 申万宏源证券有限公司 | www.swhysc.com | 95523、400-889-5523 |
| 9 | 兴业证券股份有限公司 | www.xyzq.com.cn | 95562 |
| 10 | 长江证券股份有限公司 | www.95579.com | 95579、400-888-8999 |
| 11 | 国投证券股份有限公司 | http://www.essence.com.cn/ | 95517 |
| 12 | 西南证券股份有限公司 | www.swsc.com.cn | 95355 |
| 13 | 万联证券股份有限公司 | www.wlzq.cn | 95322 |
| 14 | 渤海证券股份有限公司 | www.ewww.com.cn | 956066 |
| 15 | 华泰证券股份有限公司 | www.htsc.com.cn | 95597 |
| 16 | 中信证券(山东)有限责任公司 | sd.citics.com/ | 95548 |
| 17 | 东兴证券股份有限公司 | www.dxzq.net.cn | 95309 |
| 18 | 东吴证券股份有限公司 | www.dwzq.com.cn | 95330 |
| 19 | 东方证券股份有限公司 | www.dfzq.com.cn | 95503 |
| 20 | 方正证券股份有限公司 | www.foundersc.com | 95571 |
| 21 | 长城证券股份有限公司 | www.cgws.com | 95514、400-6666-888 |
| 22 | 中信证券华南股份有限公司 | www.gzs.com.cn | 95548 |
| 23 | 东北证券股份有限公司 | www.nesc.cn | 95360 |
| 24 | 南京证券股份有限公司 | www.njzq.com.cn | 95386 |
| 25 | 国联证券股份有限公司 | www.glsc.com.cn | 95570 |
| 26 | 浙商证券股份有限公司 | www.stocke.com.cn | 95345 |
| 27 | 平安证券股份有限公司 | www.pingan.com | 95511-8 |
| 28 | 华安证券股份有限公司 | www.hazq.com | 95318 |
| 29 | 中原证券股份有限公司 | www.ccnew.com | 95377 |
| 30 | 东海证券股份有限公司 | www.longone.com.cn | 95531、400-888-8588 |
| 31 | 恒泰证券股份有限公司 | www.cnht.com.cn | 956088 |
| 32 | 国盛证券有限责任公司 | www.gszq.com | 956080 |
| 33 | 申万宏源西部证券有限公司 | www.swhysc.com | 95523、400-889-5523 |
| 34 | 中泰证券股份有限公司 | www.zts.com.cn | 95538 |
| 35 | 华福证券有限责任公司 | www.hfzq.com.cn | 95547 |
| 36 | 中国国际金融股份有限公司 | www.cicc.com.cn | 010-65051166 |
| 37 | 华鑫证券有限责任公司 | www.cfsc.com.cn | 95323、400-109-9918 |
| 38 | 中国中金财富证券有限公司 | www.china-invs.cn | 400-600-8008、95532 |
| 39 | 东方财富证券股份有限公司 | http://www.18.cn | 95357 |
| 40 | 江海证券有限公司 | www.jhzq.com.cn | 956007 |
| 41 | 国金证券股份有限公司 | www.gjzq.com.cn | 95310 |
| 42 | 华宝证券股份有限公司 | www.cnhbstock.com | 400-820-9898 |
| 43 | 财达证券股份有限公司 | www.s10000.com | 95363(河北省内)、0311-95363(河北省外) |
| 44 | 万和证券股份有限公司 | http://www.vanho.cn/ | 4008-882-882 |
| 45 | 联储证券股份有限公司 | http://www.lczq.com | 956006 |

投资者办理本基金申购、赎回业务的具体流程、规则等以及各销售机构的业务办理状况,请参照各销售机构的规定执行。本公司可新增或调整本基金申购赎回代办证券公司并在官网(www.ChinaAMC.com)公示,投资者可登录查询。

5 基金份额净值公告的披露安排

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、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。基金上市交易后,还将在证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

6 其他需要提示的事项

(1)投资者欲了解本基金的详细情况,请登录本公司网站(www.ChinaAMC.com)查阅本基金基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等法律文件,也可拨打本公司客户服务电话(400-818-6666)了解本基金日常申购、赎回事宜。

(2)本基金将自2025年2月7日起在上海证券交易所上市交易,投资者可通过本公司网站查阅本公司于2025年1月27日发布的《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上市交易公告书》了解相关信息。

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。

投资有风险,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。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者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。投资有风险,投资者在投资基金之前,请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件,全面认识基金的风险收益特征和产品特性,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。

特此公告

华夏基金管理有限公司
二〇二五年一月二十七日

# 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上市交易公告书

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
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2025年2月7日
公告日期:2025年1月27日

一、重要声明与提示

《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上市交易公告书》(以下简称"本公告")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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")基金管理人华夏基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人兴业银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅本基金招募说明书及其更新。

二、基金概览

1、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。
2、基金简称:华夏上证基准做市公司债ETF。
3、基金二级市场交易简称:信用债基(扩位简称:信用债ETF基金)
4、基金二级市场交易代码:511200。
5、截至2025年1月23日基金份额总额:29,967,452份(份额折算后)
6、截至2025年1月23日基金份额净值:100.0401元(份额折算后)。
7、本次上市交易份额:29,967,452份。
8、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
9、上市交易日期:2025年2月7日。
10、基金管理人:华夏基金管理有限公司。
11、基金托管人:兴业银行股份有限公司。
12、登记机构:中国证券登记结算有限责任公司。
13、上市推荐人:中信证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号:中国证监会2024年12月31日证监许可[2024]1967号文。

2、基金运作方式:交易型开放式。

3、基金合同期限:不定期。

4、发售日期:2025年1月7日起至2025年1月13日止。

5、发售价格:1.00元人民币。

6、发售方式:投资者可选择网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购3种方式认购本基金。

7、发售机构

(1)网上现金发售代理机构

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。

(2)网下现金、网下债券发售机构

(i)直销机构

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。

(ii)发售代理机构

招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司等。

8、验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

9、募集资金总额及入账情况:经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次募集期间净认购金额为人民币2,996,631,000.00元,认购资金在募集期间产生的利息为人民币223,366.38元。募集资金至2025年1月16日已划入本基金托管专户。根据本基金招募说明书的规定,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。

10、基金备案情况:本公司已向中国证监会办理基金备案手续,并于2025年1月16日获中国证监会书面确认,基金合同自2025年1月16日起正式生效。

11、基金合同生效日:2025年1月16日。

12、基金合同生效日的基金份额总额:按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集及利息结转的基金份额共计2,996,745,208份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。

13、基金份额折算

根据本基金基金合同、招募说明书等有关规定,本公司以2025年1月17日为基金份额折算日对本基金进行了基金份额折算。本次基金份额折算前本基金基金份额总额为2,996,745,208份,折算后本基金基金份额总额为29,967,452份。

本基金登记机构已于2025年1月20日对本基金基金份额进行了变更登记。

(二)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2025]31号。

2、上市交易日期:2025年2月7日。

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称:信用债基(扩位简称:信用债ETF基金)。

5、基金二级市场交易代码:511200。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、本次上市交易份额:29,967,452份。

7、未上市交易份额的流通规定:本基金所有份额均上市交易。

8、基金资产净值的披露:在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、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,并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2025年1月23日,本基金基金份额持有人户数为1,215户,平均每户持有的基金份额24,664.57份。

(二)持有人结构

截至2025年1月23日,机构投资者持有的本基金基金份额为28,610,462份,占基金总份额的95.47%;个人投资者持有的本基金基金份额为1,356,990份,占基金总份额的4.53%。

截至2025年1月23日,本基金管理人的从业人员持有本基金基金份额为50.00份,占基金总份额比例为0.00%。本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

(三)前十名持有人

截至2025年1月23日,本基金前十名基金份额持有人情况如下:

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有基金份额(份) | 占总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中信证券股份有限公司 | 4,000,000.00 | 13.35% |
| 2 | 兴业银行股份有限公司 | 3,000,250.00 | 10.01% |
| 3 | 广发证券股份有限公司 | 2,750,802.00 | 9.18% |
| 4 | 中国国际金融股份有限公司 | 2,000,000.00 | 6.67% |
| 5 | 申万宏源证券有限公司 | 1,999,990.00 | 6.67% |
| 6 | 中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—粤湾15号集合资金信托计划 | 1,000,000.00 | 3.34% |
| 6 | 中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—粤湾16号集合资金信托计划 | 1,000,000.00 | 3.34% |
| 6 | 中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—粤湾8号集合资金信托计划 | 1,000,000.00 | 3.34% |
| 6 | 中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—粤湾9号集合资金信托计划 | 1,000,000.00 | 3.34% |
| 10 | 国信证券股份有限公司 | 500,000.00 | 1.67% |
| 10 | 恒泰证券股份有限公司 | 500,000.00 | 1.67% |
| 10 | 招商证券股份有限公司 | 500,000.00 | 1.67% |

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、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
法定代表人:张佑君
总经理:李一梅
信息披露负责人:李彬
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
注册资本:23800万元
设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]16号
工商登记注册的法人营业执照文号:91110000633694065 3
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。

2、股权结构

| 持股单位 | 持股占总股本比例 |
|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 62.2% |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 27.8% |
| 天津海鹏科技咨询有限公司 | 10% |
| 合计 | 100% |

3、内部组织结构与人员情况

公司设置了合理的组织结构,并根据业务需要进行了合理的人员配置。

公司业务部门主要分为投研部门、风险控制部门、营销部门、后台运作部门等。其中,投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作;风险控制部门主要负责投资的事前、事中、事后风险合规监控等工作;营销部门主要负责营销和市场推广等工作;后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。

4、基金管理业务情况

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉、沈阳设有分公司,在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通ETF基金管理人、首批商品期货ETF基金管理人、首批纳入互联互通ETF基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募REITs管理人,国内首家承诺"碳中和"具体目标和路径的公募基金公司,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。近27年来,公司秉承"为信任奉献回报"的企业宗旨,坚持以专业、严谨的投资研究为基础,为投资人提供优质的基金产品和理财服务。凭借规范的经营管理和良好的品牌声誉,公司多次荣获境内外权威奖项。

截至目前,公司旗下管理463只公募基金,品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、QDII、FOF、公募REITs等不同类型,建立了覆盖高中低风险等级的公募基金产品线,为各类风险偏好投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

5、本基金基金经理简介

文世伦先生,硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员,中融基金管理有限公司投资经理。2022年8月加入华夏基金管理有限公司,历任华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2023年3月21日至2024年4月9日期间)、华夏鼎誉三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(2023年3月21日至2024年4月9日期间)等,现任华夏永利一年持有期混合型证券投资基金基金经理(2023年3月21日起任职)、华夏上证基准做市国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2023年12月13日起任职)、华夏鼎昭利率债债券型证券投资基金基金经理(2024年2月6日起任职)、华夏鼎安一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2024年2月26日起任职)、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2024年4月9日起任职)、华夏鼎庆一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2024年11月19日起任职)、华夏鼎英债券型证券投资基金基金经理(2024年11月19日起任职)、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经理(2025年1月16日起任职)、华夏鼎合债券型证券投资基金基金经理(2025年1月23日起任职)。

(二)基金托管人

1、基本情况

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:上海市银城路167号
邮政编码:200120
法定代表人:吕家进
成立日期:1988年8月22日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行总行,银复[1988]347号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[2005]74号
组织形式:股份有限公司
注册资本:207.74亿元人民币
存续期间:持续经营

2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本207.74亿元。截至2024年6月30日,兴业银行资产总额达10.35万亿元,实现营业收入1130.43亿元,同比增长1.80%,实现归属于母公司股东的净利润430.49亿元。开业三十多年来,兴业银行始终坚持"真诚服务,相伴成长"的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

3、托管业务部部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2024年12月31日,兴业银行共托管证券投资基金758只,托管基金的基金资产净值合计26081.79亿元,基金份额合计24654.03亿份。

4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2024年9月30日,兴业银行共托管证券投资基金743只,托管基金的基金资产净值合计25025.72亿元,基金份额合计23824.75亿份。

(三)基金上市推荐人

名称: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

(四)验资机构

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
经办注册会计师:蒋燕华、王海彦
联系人:蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

截至2025年1月23日,本基金的资产负债表如下(未经审计):

单位:人民币元

| 资产 | 2025年1月23日 |
|---|---|
| 资产: | |
| 货币资金 | 749,185,097.14 |
| 结算备付金 | – |
| 存出保证金 | – |
| 交易性金融资产 | 1,312,291,638.10 |
| 其中:股票投资 | – |
| 基金投资 | – |
| 债券投资 | 1,312,291,638.10 |
| 资产支持证券投资 | – |
| 贵金属投资 | – |
| 其他投资 | – |
| 衍生金融资产 | – |
| 买入返售金融资产 | 1,180,293,147.48 |
| 应收清算款 | – |
| 应收股利 | – |
| 应收申购款 | – |
| 递延所得税资产 | – |
| 其他资产 | 223,366.38 |
| 资产总计 | 3,241,993,249.10 |
| 负债和净资产 | |
| 负债: | |
| 短期借款 | – |
| 交易性金融负债 | – |
| 衍生金融负债 | – |
| 卖出回购金融资产款 | – |
| 应付清算款 | 243,923,861.65 |
| 应付赎回款 | – |
| 应付管理人报酬 | 86,222.20 |
| 应付托管费 | 28,740.73 |
| 应付销售服务费 | – |
| 应付投资顾问费 | – |
| 应交税费 | 4,730.74 |
| 应付利润 | – |
| 递延所得税负债 | – |
| 其他负债 | 4,000.00 |
| 负债合计 | 244,047,555.32 |
| 净资产: | |
| 实收基金 | 2,996,745,208.00 |
| 未分配利润 | 1,200,485.78 |
| 净资产合计 | 2,997,945,693.78 |
| 负债和净资产总计 | 3,241,993,249.10 |

注:截至2025年1月23日,本基金基金份额净值为100.0401元,基金份额总额为29,967,452份。

八、基金投资组合

本基金目前仍处于建仓期,在上市首日前,基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

截至2025年1月23日(本基金合同自2025年1月16日起生效,本报告期为2025年1月16日起至2025年1月23日止),本基金的投资组合情况如下:

(一)报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | – | – |
| | 其中:股票 | – | – |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 1,312,291,638.10 | 40.48 |
| | 其中:债券 | 1,312,291,638.10 | 40.48 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | 1,180,293,147.48 | 36.41 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 749,185,097.14 | 23.11 |
| 8 | 其他各项资产 | 223,366.38 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 3,241,993,249.10 | 100.00 |

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中:政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | 1,312,291,638.10 | 43.77 |
| 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 | 1,312,291,638.10 | 43.77 |

(五)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本基金

| 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 | 240122 | 23延长K7 | 800,000 | 84,542,619.18 | 2.82 |
| 2 | 115169 | 23光明01 | 800,000 | 83,262,794.52 | 2.78 |
| 3 | 240213 | 23鲁高K2 | 800,000 | 82,263,627.40 | 2.74 |
| 4 | 240046 | 23皖交05 | 800,000 | 82,163,791.78 | 2.74 |
| 5 | 240924 | 24中化04 | 760,000 | 81,315,606.58 | 2.71 |

(六)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。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)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。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

(十一)投资组合报告附注

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。

2、本基金本报告期末未持有股票,不存在基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

3、其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | – |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | 223,366.38 |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 223,366.38 |

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、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。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

(一)2025年1月17日发布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合同生效公告。

(二)2025年1月17日发布关于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折算的公告。

(三)2025年1月21日发布关于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折算结果的公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

本基金托管人就本基金上市交易后履行的相关职责做出以下承诺:

在本基金上市后,我行承诺严格遵照《基金法》等相关法规以及《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合同》、《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托管协议》的约定履行相应职责。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下:

(一)本基金上市符合《基金法》《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;

(二)基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

(一)备查文件目录

1、中国证监会准予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注册的批复
2、《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合同》
3、《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托管协议》
4、《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》
5、法律意见书
6、基金管理人业务资格批件、营业执照
7、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
二〇二五年一月二十七日

附件:基金合同摘要

第一部分 基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

(一)基金管理人简况

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
法定代表人:张佑君
设立日期:1998年4月9