（上接A5版）

住所：广西南宁市滨湖路46号
办公地址：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
电话：0771-5539262
传真：0771-5539033
联系人：覃浩芳
网址：www.ghzq.com.cn
客户服务电话：全国：400-888-8100，广西：96100

(65) 财富证券有限责任公司
住所：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼
法定代表人：周晖
客户服务电话：0731-4403319
传真：0731-4403349
联系人：郭磊
网址：www.cfzq.com

(66) 东莞证券有限责任公司
住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：游锦辉
电话：0769-22119426、0769-22119351
传真：0769-22119423
联系人：张建平、罗绍辉
网址：www.dgzq.com.cn
客户服务电话：0769-961130

(67) 中原证券股份有限公司
住所：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址：郑州市经三路15号广汇国贸11楼
法定代表人：石保上
电话：0371-65585670
传真：0371-65585665
联系人：程月艳、耿铭
网址：www.ccnew.com
客户服务电话：967218，400-813-9666

(68) 国都证券有限责任公司
住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人：常喆
电话：010-84183389
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静
网址：www.guodu.com
客户服务电话：400-818-8118

(69) 东海证券有限责任公司
住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人：朱利敏
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
联系人：李海
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：021-52574550，0519-88166222，0379-64902266，400-888-8588

(70) 国盛证券有限责任公司住所：江西省南昌市永叔路15号
办公地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人：管荣升
客户服务电话：0791-6285337
传真：0791-6288690
联系人：徐美云
网址：www.gsstock.com

(71) 宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010-88085201
传真：010-88085195
联系人：李巍
网址：www.hysec.com
客户服务电话：400-800-0562

(72) 齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经十路128号
办公地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
电话：0531-81283906
传真：0531-81283900
联系人：吴阳
网址：www.qlzq.com.cn
客户服务电话：95538

(73) 第一创业证券有限责任公司
住所：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人：刘学民
电话：0755-25832494
传真：0755-25831718
联系人：王立洲
网址：www.fcsc.cn
客户服务电话：0755-25832523

(74) 金元证券股份有限公司
住所：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：石保上
电话：0755-83025666
传真：0755-83025625
联系人：金春
网址：www.jyzq.cn
客户服务电话：400-888-8228

(75) 中航证券有限公司
住所：南昌市抚河北路291号
办公地址：南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
联系人：余雅娜
网址：www.avicsec.com
客户服务电话：400-886-6567

(76) 华林证券有限责任公司
住所：珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼
法定代表人：段文清
电话：0755-82707853
传真：0755-82707850
联系人：骆扬
网址：www.chinalions.com
客户服务电话：各地营业部客户服务电话

(77) 财邦证券有限责任公司
住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人：方加春
电话：021-68761616
传真：021-68767981
联系人：罗芳
网址：www.tebon.com.cn
客户服务电话：400-888-8128

(78) 西部证券股份有限公司
住所：陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼
办公地址：陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼
法定代表人：刘建武
电话：029-87406488
传真：029-87406387
联系人：冯萍
网址：www.westsecu.com.cn
客户服务电话：029-95582

(79) 广发华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人：黄金琳
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
联系人：张腾
网址：www.ghfzq.com.cn
客户服务电话：0591-96326

(80) 光龙证券有限责任公司
住所：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
电话：0931-4890100
联系人：李昕田
网址：www.hlzqgs.com
客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

(81) 中国国际金融有限公司
住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：李剑阁
电话：010-65051166
传真：010-65058065
联系人：罗春蓉
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166

(82) 财通证券有限责任公司
住所：杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人：沈继宁
电话：0571-87925129
传真：0571-87828042
联系人：乔骏
网址：www.ctsec.com
客户服务电话：0571-96336

(83) 华鑫证券有限责任公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5045号深业大厦25层2512、2513
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01
法定代表人：王文学
电话：021-64339000-826、021-64374864
传真：021-64374864
联系人：杨小江
网址：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：021-32109999、029-68918888

(84) 瑞银证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：刘弘
电话：010-58328752、010-58328725
传真：010-58328748
联系人：谢亚凡
网址：www.ubssecurities.com@客户服务电话：400-887-8827

(85) 中国建银投资证券有限责任公司
住所：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人：杨小阳
电话：0755-82026521
传真：0755-82026539
联系人：刘权
网址：www.cjis.cn
客户服务电话：400-600-8008

(86) 中山证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：吴水良
电话：0755-82570586
传真：0755-82960582
联系人：李珍
网址：www.zsszq.com
客户服务电话：400-830-8088

(87) 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：凌顺平
电话：0551-2207951
传真：0551-2207916
联系人：刘倩
网址：www.gyzq.com.cn
客户服务电话：0551-96888

(88) 长城证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、15、16、17、18层
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、15、16、17、18层
法定代表人：丁益
电话：0755-83516289
传真：0755-83516189
联系人：宋丽
网址：www.cgws.com
客户服务电话：0755-33680000

(89) 华龙证券有限责任公司
住所：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号
法定代表人：李晓安
电话：0931-4890100
联系人：李昕田
网址：www.hlzqgs.com
客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

(90) 华融证券股份有限责任公司
住所：北京市西城区金融街1号
办公地址：北京市西城区金融街1号
法定代表人：范勇宏
客户服务电话：400-818-6666
传真：010-63136700
联系人：张金锋

（三）律师事务所
名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
联系电话：010-52682888
传真：010-52682999
联系人：李晓明
经办律师：徐建军、李晓明

（四）会计师事务所
本公司聘请的法定验资机构为德勤华永会计师事务所有限公司。
名称：德勤华永会计师事务所有限公司
住所：上海市延安东路222号外滩中心30楼
办公地址：中国北京市东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层
法定代表人：谢英峰
联系电话：010-85207788
传真：010-85181218
联系人：吴蓉
经办注册会计师：郭新华、吴蓉

六、基金的募集

（一）基金的历史沿革
本基金由亚洲债券基金第二期中国子基金专户转开放而来。
亚洲债券基金第二期中国子基金经中国证监会《关于第二期亚洲债券基金中国子基金有关问题的函》（证监办函［2005］68号）认可，由华夏基金管理有限公司担任基金管理人，以接受特定对象财产委托从事证券投资活动的形式从事中国子基金投资管理。基金持有人为东亚及太平洋中央银行行长会议组织（Executives' Meeting of East Asia and Pacific Central Banks，简称"EMEAP"）。基金投资主要采用代表性分层抽样复制策略，跟踪iBoxx？亚债中国指数。
经监管部门批准，亚洲债券基金第二期中国子基金由专户转为开放式基金公开募集，基金投资方向和投资策略与专户阶段完全相同。为节约基金建仓成本，EMEAP将以专户资产（含现券和现金）换购为基金份额继续持有。

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

（三）基金类型和存续期间
1.基金的类型：债券基金。
2.基金的运作方式：契约型开放式。
3.基金存续期间：不定期。

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

（五）募集期限
本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。
本基金自2011年4月26日至2011年5月23日进行发售。如果在此期间未达到本招募说明书第七条第（一）款规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

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

（七）募集场所
投资者应当在基金管理人、代销机构办理基金发售业务的营业场所或按基金管理人、代销机构提供的其他方式办理基金的认购。销售机构名单和联系方式具体见本基金发售公告。
基金管理人、代销机构办理基金发售业务的地区、网点的具体情况和联系方法，请参见本基金发售公告以及当地销售机构的公告。
基金管理人可以根据情况增加其他代销机构，并另行公告。

（八）基金份额类别
本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，A类在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费，不收取销售服务费；C类不收取前后端认购/申购费，销售服务费年费率为0.4%。本基金A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。
根据基金销售情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，增加新的基金份额类别、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者终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发时公告并报中国证监会备案。

（九）认购安排
1.认购时间：2011年4月26日至2011年5月23日。具体业务办理时间以各销售机构的规定为准。
2.认购程序：投资者在首次认购本基金时，需按销售机构的规定，提出开立华夏基金管理有限公司基金账户和销售机构交易账户的申请。一个投资者只能开立和使用一个基金账户，已经开立华夏基金管理有限公司基金账户的投资者可免予申请。
3.认购原则：认购以金额申请。投资者认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项。投资者可以多次认购本基金份额，每次认购金额不得低于1,000元。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。
4.认购申请的确认：销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以登记结算机构的确认为准。投资者应在基金合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。
投资者开户和认购所需提交的文件和办理的具体手续由基金管理人和销售机构约定，请投资者参阅本基金发售公告。

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

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

投资者如认购C类基金份额，则前端认购费为0。
2.本基金认购费由认购人承担，认购费不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。
3.投资者重复认购时，需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。

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

（十二）认购份额的计算
本基金A类、C类基金份额的初始面值均为1.00元。
1.当投资者选择认购A类基金份额时，认购份额的计算方法如下：
①认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：
净认购金额=认购金额/（1+前端认购费率）
前端认购费用=认购金额-净认购金额
认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/1.00元
②认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：
前端认购费用=固定金额
净认购金额=认购金额-前端认购费用
认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/1.00元
2.当投资者选择认购C类基金份额时，认购份额的计算方法如下：
认购份额=（认购金额+认购资金利息）/1.00元
3.认购份额的计算按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。
例一：某投资者投资1,000元认购本基金A类基金份额，假设这1,000元在募集期间产生的利息为0.46元，则其可得到的基金份额计算如下：
净认购金额=1,000/（1+0.6%）=994.04元
前端认购费用=1,000-994.04=5.96元
认购份额=（994.04+0.46）/1.00=994.50份
即投资者投资1,000元认购本基金A类基金份额，加上募集期间利息后一共可以得到994.50份A类基金份额。
例二：某投资者投资1,000元认购本基金C类基金份额，假设这1,000元在募集期间产生的利息为0.46元，则其可得到的基金份额计算如下：
认购份额=（1,000+0.46）/1.00=1,000.46份
即投资者投资1,000元认购本基金C类基金份额，加上募集期间利息后一共可以得到1,000.46份C类基金份额。

（十三）特殊投资者EMEAP的认购
EMEAP提供对本基金的初始投资，该部分投资已自2005年6月起以独立账户形式运作，目前资产规模约为21亿元人民币。为节约建仓成本，EMEAP初始投资组合将以现券和少量现金的形式直接认购为本基金A类基金份额。认购时间为发售期的最后一日，债券认购折算份额按照基金合同规定的估值方法确定。
EMEAP由下列亚太区的中央银行和金融当局组成：澳大利亚储备银行、中国人民银行、香港金融管理局、印度尼西亚央行、日本央行、韩国央行、马来西亚央行、新西兰储备银行、菲律宾央行、新加坡金融管理局和泰国央行。
EMEAP的中央银行和金融当局成员作为基金份额持有人，与其他基金份额持有人享有同等权利，可在基金开放后赎回或转换其持有的基金份额而且不需事先公告。

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

七、基金合同的生效

（一）基金备案条件
基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理基金验资和备案手续：
1.基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（含EMEAP初始投资）不少于2亿元人民币；
2.基金份额持有人的人数不少于200人。

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

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

（四）基金募集失败
基金募集期限届满，未具备上述基金备案条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效的，则基金募集失败，基金合同不生效。
基金募集失败时，基金管理人应当以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并应在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

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

八、基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购和赎回场所
本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。投资者应当在销售机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。
基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间
1.开放日及开放时间
投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。
若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并提前公告。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回等业务。投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。

（三）申购、赎回的开始时间
本基金在自基金合同生效日起不超过3个月的时间内开放申购、赎回。
基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少1个工作日在至少一种指定媒体公告。

（四）申购和赎回的原则
1. 先知价"原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2. 金额申购、份额赎回"原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3.本基金份额分为多个类别，适用不同的申购费、销售服务费，投资者在申购时可自行选择基金份额类别；
4.投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续，办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准；
5.当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；
6.基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前2日在至少一种指定媒体公告。

（四）申购和赎回的数额限制
1.投资者每次最低申购金额为1,000元（含申购费）。
2.基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于100份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足100份的，在赎回时需一次全部赎回。
3.基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购金额、赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整的2日前在至少一种指定媒体上公告。

（五）申购和赎回的程序
1.申购和赎回申请的提出
投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回的申请。
投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，其在销售机构（网点）须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。
2.申购和赎回申请的确认与通知
投资者T日申购基金成功后，登记结算机构在T+1日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。投资者T日赎回基金成功后，登记结算机构在T+1日为投资者办理扣减权益的登记手续。
T日规定时间受理的申请，正常情况下投资者应在T+2日后（包括该日）通过本公司网站、客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况，打印确认单。
基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。
3.申购与赎回申请的款项支付
申购时，采用金额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功的款项将退回投资者账户。
赎回时，当投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照基金合同、招募说明书和有关法律法规规定处理。

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

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

申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。
2.本基金C类基金份额不收取申购费。
3.本基金A类、C类基金份额均收取赎回费，赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。赎回时份额持有不满90天的，收取0.3%的赎回费，持有满90天以上（含90天）的，赎回费为0。其中，所收取赎回费总额不低于25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。
4.基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。
5.经中国证监会允许，基金管理人可以在遵守法律法规及基金合同规定的条件下，针对特定期间或符合特定条件的投资者，采取调低基金申购费、赎回费或调高基金赎回费等措施，基金管理人须于该等措施实施前至少1个工作日在至少一种指定媒体公告。

（七）申购份额与赎回金额的计算方式
1.申购份额的计算
①当投资者选择申购A类基金份额时，申购份额的计算方法如下：
①申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：
净申购金额=申购金额/（1+前端申购费率）
前端申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日A类基金份额净值
②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：
前端申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-前端申购费用
申购份额=净申购金额/T日A类基金份额净值
②当投资者选择申购C类基金份额时，申购份额的计算方法如下：
申购份额=申购金额/T日C类基金份额净值
③基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。
例三：假定T日基金的A类基金份额净值为1.230元，若三笔申购金额分别为1,000元、100万元和500万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

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

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

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

例四：假定T日基金的C类基金份额净值为1.200元，申购金额为10万元，则申购获得的基金份额计算如下：
申购份额=100,000/1.200=83,333.33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：
赎回金额=赎回份额×T日A类基金份额净值
赎回费用=赎回金额×赎回费率
净赎回金额=赎回金额-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：
赎回金额=赎回份额×T日C类基金份额净值
赎回费用=赎回金额×赎回费率
净赎回金额=赎回金额-赎回费用
例五：假定某投资者在T日赎回10,000份A类基金份额，持有期限20天，该日A类基金份额净值为1.250元，则其获得的赎回金额计算如下：
赎回金额=10,000×1.250=12,500.00元
赎回费用=12,500×0.3%=37.50元
净赎回金额=12,500-37.5=12,462.50元
例六：假定某投资者在T日赎回10,000份C类基金份额，持有期限95天，该日C类基金份额净值为1.225元，则其获得的赎回金额计算如下：
赎回金额=10,000×1.225=12,250.00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，计算公式为计算该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（八）拒绝或暂停申购的情形
在发生下列情形时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：
1.不可抗力导致基金无法接受申购；
2.证券交易场所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3.发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
4.因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券即将上市或进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人利益的；
5.基金资产规模过大，使基金管理人无法顺利实施投资策略，可能对基金业绩产生负面影响，从而损害已有基金份额持有人的利益；
6.个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；
7.基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的；
8.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。
基金管理人决定拒绝接受某类投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
在发生下列情形时，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：
1.不可抗力导致基金无法支付赎回款项；
2.证券交易场所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3.发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
4.基金连续2个开放日及以上发生巨额赎回；
5.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人在有能力兑付时，应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例受理赎回申请人的部分赎回申请，其余赎回申请顺延期办理，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。赎回申请的延期办理最迟不得超过正常支付时间20个工作日。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

（十）巨额赎回的认定及处理方式
1.巨额赎回的认定
单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。
2.巨额赎回的处理方式
出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。
①接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。
②部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分给投资者在提交赎回申请时选择转当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。
当发生巨额赎回并部分延期办理时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在2日内通过至少一种指定媒体刊登公告，说明有关处理方法。
本基金连续2个开放日以上（含2个开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过20个工作日，并应当在至少一种指定媒体公告。

（十一）申购和赎回暂停期间与重新开放的公告
暂停申购或暂停赎回结束、基金重新开放时，基金管理人应在至少一种指定媒体公告：
1.如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金份额净值。
2.如果发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应至少提前1个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。
3.如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应至少提前2日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

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

九、基金的转托管与非交易过户等其他业务

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

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

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

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

十、基金的投资

（一）投资目标
本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。

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

（三）投资策略
本基金为被动管理基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。
1.债券指数化投资
①组合构建策略
构建投资组合的过程主要分为3步：指数成份券流动性筛选、确定目标组合和逐步调整建仓。
①指数成份券流动性筛选：通过日均交易量、报价次数、买卖价差和是否为跨市场债券等定量和定性指标，筛选具有较好流动性的指数成份券作为组合备选券。
②确定目标组合：使用代表性分层抽样法确定各备选券权重，使组合总体特征与指数相似。
③逐步调整建仓：根据市场实际流动性情况和投资机会，进一步调整和优化组合并逐步建仓。
在一般情况下，本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产净值的90%。本基金将在基金合同生效之日起6个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份券调整、基金申购或赎回带来资金流动等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。
②月度组合管理
①根据标的指数月度调整，对组合持有的债券及其权重进行调整，保证组合总体特征与调整后的标的指数相似。
②根据基金费用、收益分配等支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。
③在公司研究团队月度策略会议上对组合操作及跟踪误差等进行分析，分析最近组合与标的指数总回报的差异情况，找出相应原因。
④公司投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。
③跟踪误差目标
在正常市场情况下，本基金追求债券指数化投资组合在扣除基金费用前的总回报与标的指数总回报之间的年化跟踪误差不超过50个基点（一个基点为万分之一）。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
2.衍生品投资
未来，如法律法规或监管机构允许基金投资衍生品的，经持有人大会同意后，基金可以参与相关衍生品投资。基金衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征，以便更好地实现基金的投资目标。基金将主要投资于与利率、标的指数、标的指数成份券或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；投资监负责面向基金公司的投资、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