上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

（上接B17版）

4.认购申请：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5.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第4个工作日将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

6.认购确认：在募集期结束后3个工作日之后，投资人应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（4）网下现金认购

1.认购时间：2014年10月17日起至2014年11月7日，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2.认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人单笔认购须为1000份或其整数倍。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份），超过部分须为1万份的整数倍。投资人在募集期内可多次认购，认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

3.认购金额的计算

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算：

认购费用＝认购价格×认购份额×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用＝固定费用）

认购金额＝认购价格×认购份额×（1＋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）

净认购份额＝认购份额＋认购金额产生的利息／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。

（2）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.认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

5.清算交收：T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于T＋2日进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以登记机构的记录为准，利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去。

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基金管理人预先开设的基金募集专户。

6.认购确认：在募集期结束后3个工作日之后，投资人应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（5）网下债券认购

1. 认购时间：通过发售代理机构及基金管理人进行网下债券认购的时间为2014年10月17日起至2014年11月7日。具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2.认购限额：网下债券认购以单只债券手数申报，用以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。单只债券最低认购申报数为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。投资人可以多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

3.认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购债券。网下债券认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

4.特殊情形

⑴已公告的将被调出标的指数的成份券不得用于认购本基金。

⑵限制个券认购规模：基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、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。

⑶临时拒绝个券认购：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。

5.清算交收：投资人通过发售代理机构办理网下债券认购的，每日日终，发售代理机构将当日的债券认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人，在网下债券认购最后一日，基金管理人初步确认各成份债券的有效认购数量。登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资人账户内相应的债券进行冻结。基金募集期结束后，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购佣金，并从投资人的认购份额中扣除，然后将扣除的认购佣金以基金份额的形式返还给发售代理机构。

登记机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记，并根据基金管理人报上海证券交易所确认的有效认购申请债券数据，将投资人申请认购的债券过户到基金的证券账户。

6.认购份额的计算公式：

其中：

（1）i代表投资人提交认购申请的第i只债券，n代表投资人提交的债券总只数。如投资人仅提交了1只债券的申请，则n＝1。

（2）T日为网下债券认购期最后一日。

（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日的中央国债登记结算有限责任公司估值价（注：如无特别所指，则为估值净价）＋（D－1）日应计利息。

若某一债券在T日至登记机构进行债券过户日（D日）的冻结期间发生利息兑付等权益变动情况，则由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将相应调整应计利息的计算。

（5）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的债券数量。其中，

①若基金管理人在网下债券认购日前公告了限制认购规模的个券名单，则对于经公告限制认购规模的个券，基金管理人可确认的认购数量上限的确认方法在届时公告中列示。

②若某一债券在网下债券认购日至登记机构进行债券过户日（D日）的冻结期间发生司法执行，则基金管理人将根据登记结算机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

7.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：

认购佣金＝认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金＝固定费用）

净认购份额＝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：

认购佣金＝认购价格×认购份额／（1＋佣金比率）×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金＝固定费用）

净认购份额＝认购份额－认购佣金／1.00

认购份额、净认购份额和以基金份额的方式支付认购佣金的计算保留到整数位，小数点后部分舍去。

二、发售方式及相关规定

1、发售对象

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者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。

2、发售方式

投资人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。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的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人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指定的发售代理机构以债券进行的认购。

3、发售场所

投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所或按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见本基金基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并另行公告。

三、投资人的开户与认购程序

投资者的开户与认购程序

投资者认购本基金时需具有持有证券账户，即上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户。

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，如投资者需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立A股账户。

（2）投资者开立证券账户，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海A股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

（3）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提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

3、使用专用交易单元的机构投资人则无需办理指定交易。

4、网上现金认购的程序

（1）业务办理时间：2014年11月5日起至2014年11月7日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00

（2）认购手续：

1)开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户，办理指定交易或转指定交易在本基金的发售代理机构。

2)在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3)投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

5、网下现金认购的程序

（1）直销机构

1）本公司直销中心接受单笔认购份额在100,000份以上（含100,000份）以上的个人、机构投资者的网下现金认购，超过部分须为1万份的整数倍。

2）业务办理时间：2014年10月17日起至2014年11月7日的9:30-17:00(周六、周日照常受理)。

3）认购手续

投资者须先开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户，然后到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

① 个人投资者提供有效身份证件（身份证、军官证、士兵证、中国护照、户口簿等）原件及复印件；

② 机构投资者提供机构营业执照复印件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书，印鉴卡一式三份；

③ 上海证券交易所A股股东代码卡或证券投资基金账户代码卡，个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户时登记的证件一致；

④ 个人投资者提供指定银行账户的证明原件及复印件，机构投资者提供指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件（或指定银行出具的开户证明）。个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立该指定银行账户时登记的证件一致；

⑤ 投资者填写认购委托单，机构投资者还须加盖单位公章；

注：“指定银行账户”是指：在本直销中心通过网下现金认购本基金的投资者需指定一银行账户作为若认购申请确认失败后认购资金的回款账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户。账户证明是指银行存折、借记卡等。

4）开户后，在办理认购手续前，应将足额资金通过银行系统汇入本公司指定银行账户：

户名	海富通基金管理有限公司
账号	31001550400050006498
开户行	中国建设银行上海市分行营业部
大额支付系统行号	105290036005

② 汇款时，投资者必须注意以下事项：

a.投资者应在“汇款人”栏中填写其开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户时登记的名称；

b.投资者汇款时，可提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息，包括在用途栏内注明“认购上证可质押城投债ETF”；

c. 为了确保投资者资金及时准确的入账，建议投资者将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至海富通基金管理有限公司直销中心。

（2）发售代理机构

1）业务办理时间：2014年10月17日起至2014年11月7日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00(周六、周日不营业)，具体时间以各发售代理机构的规定为准。

2）认购手续：

① 开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户，办理指定交易或转指定交易。

② 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。

6、网下债券认购的程序

（1）直销机构

1）业务办理时间：2014年10月17日起至2014年11月7日的9:30-17:00(周六、周日照常受理)。

2）认购手续：

投资者须先开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户，然后到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

① 个人投资者提供有效身份证件（身份证、军官证、士兵证、中国护照、户口簿等）原件及复印件；

② 机构投资者提供机构营业执照复印件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书，印鉴卡一式三份；

③ 上海证券交易所A股股东代码卡，个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所A股账户时登记的证件一致；

④ 个人投资者提供指定银行账户的证明原件及复印件，机构投资者提供指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》原件及复印件（或指定银行出具的开户证明）。个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立该指定银行账户的时登记的证件一致；

⑤ 在A股账户中具备足够的符合要求的上证可质押城投债指数成份券和已公告的备选成份券中未限制认购规模的个券。

⑥ 投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购债券即被冻结。如登记机构办理债券冻结业务时，投资者A股账户中的债券余额不足，则基金管理人有权将投资者的该笔债券认购申请部分或全部确认失败。

注：“指定银行账户”是指：在本直销中心通过网下债券认购本基金的投资者需指定一银行账户作为若认购申请确认失败后认购款项的回款账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户。账户证明是指银行存折、借记卡等。

（2）发售代理机构

1）业务办理时间：2014年10月17日起至2014年11月7日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00(周六、周日不受理)。具体时间以各发售代理机构的规定为准。

2）认购手续：

① 开立上海证券交易所A股账户，办理指定交易或转指定交易。

② 在A股账户中具备足够的符合要求的上证可质押城投债指数成份券和已公告的备选成份券。

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。

（3）特殊情形

1)已公告的将被调出上证可质押城投债指数的成份券不得用于认购本基金。

2)限制个券认购规模：基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、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至少3个工作日公告限制认购规模的个券名单。

3)临时拒绝个券认购：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。

四、清算与交割

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人所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；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至划入基金托管专户前产生的利息计入基金资产；投资者以债券认购的，认购债券由登记机构予以冻结，冻结期间的权益归投资者所有。本基金合同生效前，基金募集期间募集的资金存入专门账户，任何人不得动用；网下债券认购所募集的债券由登记机构予以冻结。本基金权益登记由登记机构在发售结束后完成过户登记。

五、基金的验资与基金合同的生效

1. 本基金募集期限届满，由基金管理人按规定聘请法定验资机构对认购资金进行验资并出具验资报告，基金登记机构出具认购户数证明。

2. 基金管理人应当按照规定办理基金备案手续；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。

3. 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。

4. 募集期限届满，若本基金不能满足基金备案的条件，基金管理人将：以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；在基金募集期限届满后三十日内返还投资人已缴纳的认购款项，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。

六、本次发售当事人或中介机构

（一）基金管理人：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：张文伟

成立时间：2003年4月18日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

客户服务中心电话：40088－40099（免长话费）

公司网址：www.hftfund.com

（二）基金托管人：中国银行股份有限公司

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

（三）销售机构

（1）上市推荐人

海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553或4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

（2）发售协调人

主协调人：

海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553或4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

（3）网下现金发售和网下债券发售直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：张文伟

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-38650797

传真：021-33830160

（4）网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构（其中财富证券有限责任公司和中国国际金融有限公司不代理网下债券认购）

1） 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553或4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

2） 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

3） 德邦证券有限责任公司

住所：上海市福山路500号城建国际中心26层

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

4） 申银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

客户服务电话：95523，4008895523

联系人：黄莹

网址：www.sywg.com.cn

（5）网上现金发售代理机构

网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：

序号	证券公司名称	序号	证券公司名称	序号	证券公司名称
1	爱建证券有限责任公司	34	国信证券股份有限公司	67	首创证券有限责任公司
2	安信证券股份有限公司	35	国元证券股份有限公司	68	太平洋证券股份有限公司
3	渤海证券股份有限公司	36	海通证券股份有限公司	69	天风证券股份有限公司
4	财达证券有限责任公司	37	恒泰长财证券有限责任公司	70	天源证券有限公司
5	财富里昂证券有限责任公司	38	恒泰证券股份有限公司	71	万和证券有限责任公司
6	财富证券有限责任公司	39	宏信证券有限责任公司	72	万联证券有限责任公司
7	财通证券股份有限公司	40	宏源证券股份有限公司	73	西部证券股份有限公司
8	长城证券有限责任公司	41	红塔证券股份有限公司	74	西藏同信证券有限责任公司
9	长江证券股份有限公司	42	华安证券有限责任公司	75	西南证券股份有限公司
10	诚浩证券有限责任公司	43	华宝证券有限责任公司	76	厦门证券有限公司
11	川财证券有限责任公司	44	华创证券有限责任公司	77	湘财证券股份有限公司
12	大通证券股份有限公司	45	华福证券有限责任公司	78	新时代证券有限责任公司
13	大同证券经纪有限责任公司	46	华林证券有限责任公司	79	信达证券股份有限公司
14	德邦证券有限责任公司	47	华龙证券有限责任公司	80	兴业证券股份有限公司
15	第一创业证券股份有限公司	48	华融证券股份有限公司	81	银泰证券有限责任公司
16	东北证券股份有限公司	49	华泰联合证券有限责任公司	82	英大证券有限责任公司
17	东方证券股份有限公司	50	华泰证券股份有限公司	83	招商证券股份有限公司
18	东海证券股份有限公司	51	华西证券有限责任公司	84	浙商证券股份有限公司
19	东吴证券股份有限公司	52	华鑫证券有限责任公司	85	中国国际金融有限公司
20	东兴证券股份有限公司	53	江海证券有限公司	86	中国民族证券有限责任公司
21	东莞证券有限责任公司	54	金元证券股份有限公司	87	中国银河证券股份有限公司
22	方正证券股份有限公司	55	开源证券有限责任公司	88	中国中投证券有限责任公司
23	光大证券股份有限公司	56	联讯证券有限责任公司	89	中航证券有限公司
24	广发证券股份有限公司	57	民生证券股份有限公司	90	中山证券有限责任公司
25	广州证券有限责任公司	58	南京证券股份有限公司	91	中天证券有限责任公司
26	国都证券有限责任公司	59	平安证券有限责任公司	92	中信建投证券股份有限公司
27	国海证券股份有限公司	60	齐鲁证券有限公司	93	中信万通证券有限责任公司
28	国金证券股份有限公司	61	日信证券有限责任公司	94	中信证券（浙江）有限责任公司
29	国开证券有限责任公司	62	瑞银证券有限责任公司	95	中信证券股份有限公司
30	国联证券股份有限公司	63	山西证券股份有限公司	96	中银国际证券有限责任公司
31	国盛证券有限责任公司	64	上海证券有限责任公司	97	中邮证券有限责任公司
32	国泰君安证券股份有限公司	65	申银万国证券股份有限公司	98	中原证券股份有限公司
33	爱建证券有限责任公司	66	世纪证券有限责任公司		

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（四）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系人：刘永卫

电话：（021）58872625

传真：（021）68870311

（五）律师事务所：上海市通力律师事务所

地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-3135 8600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

（六）会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、叶尔甸

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：刘莉

七、网下债券认购清单

本基金募集期间，网下债券认购清单如下表所示，但是募集期结束前已公告的将被调出上证可质押城投债指数的成份债不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个债的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个债认购规模进行限制，并在网下债券认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个债名单。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的个债，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。

沪市代码	沪市名称	沪市代码	沪市名称	沪市代码	沪市名称
120512	05沪建(2)	122912	10鄂国资	124395	13堰城投
120527	05武城投	122914	09榕建债	124398	13株城发
120602	06冀建投	122915	10镇水投	124402	13丹投01
120608	06鲁高速	122920	10黄山债	124403	13丹投02
120609	06赣投债	122921	10郴州债	124404	13怀化工
120610	06合城投	122922	10长高新	124407	13泰州债
120701	07世博(1)	122924	10巢湖债	124408	13宛城投
120702	07世博(2)	122925	09沈国资	124409	13宿城投
122500	12郴城投	122926	09青国投	124412	13金利源
122501	12寿财资	122928	09铁岭债	124413	13寿城投
122502	12哈合力	122930	09盘锦债	124415	13鄂投01
122503	12并龙城	122932	09宜城债	124416	13鄂投02
122506	12吴交投	122935	09南通债	124417	13江高新
122510	12靖新城	122939	09吉安债	124421	13海新区
122514	12金融街	122940	09咸城投	124422	13崇明债
122515	12庆城投	122941	10镇城投	124424	13柳东城
122519	12锡经开	122942	09江阴债	124425	13平国资
122520	12唐城投	122944	09株城投	124426	13澄港城
122521	12筑金阳	122946	pr扬城建	124430	14城阳债
122525	12沪嘉开	122948	pr锡交债	124432	13襄建投
122527	12温国投	122949	pr常投债	124433	12沪闵行
122531	12太科园	122950	09渝能源	124435	13邯城投
122533	12平城投	122951	09淮城投	124439	13六安01
122536	12慈国控	122952	09赣州债	124440	13宁德投
122537	12克城投	122954	pr武进债	124444	13六安02
122538	12榕城乡	122956	09常高新	124446	13即墨债
122540	12宁浦口	122957	09蓉工投	124449	13常滨湖
122545	12蒙高新	122961	09武城投	124450	13周口01
122546	12宁高新	122962	09宁交通	124451	13濮建投
122547	12曲靖投	122969	09豫投债	124454	13武清01
122549	12邳润城	122972	09绵投控	124455	13越都债
122550	12苏国信	122973	pr昆创控	124456	13闽投债
122552	12新新业	122975	09济城建	124458	13镇投01
122553	12虞交通	122980	09津投3	124460	13忻州01
122555	12常经投	122982	pr长城开	124461	13清远债
122558	12昆交01	122984	09六城投	124462	13海财01
122559	12昆交02	122986	09春华债	124465	13黄冈01
122560	12淄城运	122988	09渝隆债	124466	13邕城投
122561	12饶城投	124002	12蒙高路	124467	13锦州01
122563	12亳州债	124003	12珠水务	124468	13丰城01
122564	12椒江债	124004	12盐城南	124471	13宁海01
122565	12邵城投	124005	12昆创控	124474	14怀化01
122567	12小清河	124006	12绍城投	124475	13沈湖01
122569	12津生态	124011	12锡科技	124480	14东台01
122570	12滇水投	124014	12筑住投	124481	13镇投02
122571	12兴国资	124017	12伊国资	124483	09渝地产
122572	12蓉投控	124020	12辽城经	124487	14邵城投
122573	12牡国投	124021	12潍东兴	124488	14吴兴南
122574	12淮开控	124022	12韶金叶	124489	14融强01
122577	12苏相城	124023	12滁城投	124490	14首开01
122578	12长宁债	124024	12青投资	124496	13丰城02
122581	12津南城	124027	12瑞国投	124498	14金资01
122583	12遵投债	124028	12诸城投	124499	13沈湖02
122584	12松城开	124029	12玉城投	124500	13鹏铁02
122585	12新海连	124030	12宁城投	124502	14宏财01
122586	12中交通	124031	12豫铁投	124504	11鹰投债
122587	12遵桥债	124032	12宜建投	124508	14滕州02
122589	12毕信泰	124033	12苏城投	124514	14六开投
122591	12常交债	124034	12郑城投	124517	14怀化02
122592	12乌国资	124036	12张经开	124519	14淮新01
122593	12衡城投	124037	12渝江北	124520	14太资债
122594	12泉州01	124040	12绍迪荡	124522	14连普湾
122595	12泉州02	124041	12宿水务	124524	13黔投02
122600	12鑫泰债	124046	12濮建投	124526	14邹平债
122602	12松城投	124047	12黔宏升	124529	14泉台商
122603	12穗经开	124048	12平国资	124532	14甘公01
122604	12吉铁投	124050	12榆城投	124534	14渝中债
122605	11宁海债	124051	12庆高新	124535	14眉山资
122607	12渝地产	124056	12启国投	124536	14莱开投
122608	12西永债	124057	12汕城开	124539	14富阳01
122609	12扬城控	124059	12临城发	124540	14汉车都
122610	12乐清债	124060	12驻投资	124542	14陆嘴01
122611	12蓉经01	124062	12冀顺德	124543	14临港控
122612	12蓉经02	124065	12津开01	124545	14双水01
122613	12乌海债	124066	12津开02	124548	14裕峰债
122615	12百色债	124070	12新城投	124555	14余城建
122616	12黔铁债	124071	12鹰投融	124561	14汾湖债
122617	12襄投债	124072	12曲公路	124563	14吉铁投
122618	12统众债	124074	12张公经	124565	14庆城投
122619	12迁安债	124075	12淮建投	124566	14潭两型
122620	12乌城投	124077	12榕建工	124568	14株国投
122621	12赣城债	124078	12云城建	124570	14首开02
122622	12锦城债	124081	12长先导	124573	14龙岩城
122624	12滨开债	124082	12青国信	124574	14攀国投
122626	12海恒债	124083	12黄城投	124575	14汕投资
122628	12东投债	124084	12沪临港	124576	11滇铁投
122629	12平发债	124085	12沪金投	124577	14甬广聚
122630	12惠投债	124086	12诸建投	124580	14淮开控
122632	12江阴债	124088	12东台债	124581	13黄冈02
122634	12芜开01	124090	12遵国投	124586	14陆嘴02
122635	12芜开02	124094	12甬交投	124587	14阜阳01
122636	12连发债	124095	12六开投	124588	14济宁债
122637	12鑫城债	124096	12淮城资	124589	14海晋交
122638	12申华信	124097	12宝投资	124590	13武清02
122639	12绍新城	124099	12德建投	124591	14长土开
122641	12武进债	124101	12赣高速	124592	14并国投
122642	12朝阳债	124106	12邯郸债	124593	14相城投
122644	12铁岭债	124107	12洛城投	124594	14潍东方
122645	12苏园建	124108	12吴经开	124598	14济城投
122648	12宣国投	124110	13宁新开	124600	14贵水01
122649	12长建投	124111	12长城建	124601	14唐城债
122655	12铜建投	124114	12大丰债	124604	14富阳02
122658	12盘锦债	124116	12渝北飞	124605	14温高01
122661	12怀化债	124117	12宜城投	124606	14菏泽债
122663	12科发债	124119	12环太湖	124607	14津环城
122664	12葫芦岛	124120	12泉台商	124609	14常德投
122665	12镇交投	124122	13抚城投	124610	14云铁投
122668	12凉国投	124123	13南城投	124611	14阜阳02
122669	12桂林债	124125	13温经开	124612	14永城建
122670	12新盛债	124126	12柳城投	124613	14长建投
122671	12扬子江	124134	13泉城投	124615	14昆高新
122672	12西城投	124135	13滇公投	124616	14鄂交01
122675	12杭城投	124136	13太城投	124617	14鄂交02
122676	12滨江债	124137	13赣发投	124621	14宣国资
122677	12江宁债	124138	12长城投	124623	14穗铁01
122679	12河套债	124140	13沧建投	124628	14启东01
122680	12昆建债	124142	13渝三峡	124634	14牡国投
122682	12营口债	124143	13泰投资	124635	14滕州01
122684	12合高新	124144	13蓉城投	124637	14融强02
122685	12吉城投	124145	13蓉兴城	124638	14信阳债
122691	12武清债	124146	13海发控	124640	09吴国资
122692	12漳路桥	124147	13甬东投	124641	14江宁开
122695	12五国投	124149	13镇水投	124643	14冀高开
122697	11太资债	124150	13南发展	124644	14沈国资
122701	12余城建	124151	13长兴岛	124647	14娄底债
122703	12鞍城投	124155	13渭城投	124648	14郴州债
122704	12江都债	124159	13绍城改	124650	13海财02
122705	12苏交通	124162	13济高新	124654	14庆经投
122706	12海门债	124165	13洪市政	124655	13宁海02
122709	12绵阳债	124166	13江滨投	124658	14桂城建
122710	12济城建	124167	13滇投债	124661	14赣四通
122711	12郑新债	124168	13绍中城	124662	14京投债
122713	12冀交通	124171	13长投建	124665	14余交通
122714	12海陵债	124172	13常城投	124668	14滇公路
122715	12蓉新城	124174	13吉城债	124672	14徐开发
122716	12莆田债	124176	13武地铁	124675	14崇川债
122719	12龙交投	124177	13乌高新	124676	14衢国资
122720	12甬城投	124179	13广越秀	124677	14乌城投
122722	12淮水利	124184	13京投债	124683	13周口02
122724	12攀国投	124185	13海宁债	124684	14新城基
122726	12柳东债	124187	13泰矿债	124686	14昌平债
122728	12徐经开	124188	13邹城资	124689	14雨花城投债
122731	12镇经开	124190	13奉南城	124691	14宏财02
122732	12九江债	124191	13杭高新	124692	14嘉公路
122733	11京资01	124192	13邗城建	124693	14新凯迪
122734	11京资02	124193	13文城资	124696	14东台02
122735	11六安债	124194	13滨海01	124697	14马城投
122740	12延城投	124195	13滨海02	124702	14衡水投
122742	12鲁高速	124196	13烟城建	124703	14蓉隆博
122743	12华发集	124197	10朝资01	124707	14渝江01
122744	11本溪债	124198	10朝资02	124710	14兴国资
122750	12常经营	124199	13泰交债	124711	14象山债
122752	11大丰港	124204	13津城投	124713	14黔铁投
122755	12潭城建	124205	13余创债	124718	14乌房债
122758	11张保债	124209	13三门峡	124721	14青海创
122760	12渝富债	124210	13皋投债	124722	14包滨河
122761	11萧国资	124211	13甘投债	124723	14启东02
122762	11吴江债	124215	13九国资	124725	14曲靖投
122763	11淮产投	124217	13西高新	124731	14朝建投
122766	11宜建投	124219	13荣经开	124732	14渝高开
122767	11盐城南	124220	13晋能交	124733	14开发投
122768	11兰城投	124221	13武地产	124735	14合建投
122773	11滨海01	124224	13朝国资	124736	14柳龙投
122774	11滨海02	124226	13闽兴杭	124737	14虞交通
122775	11咸城投	124227	13宁国01	124740	14青经开
122777	11吴中债	124228	13宁国02	124742	14贵水02
122779	11株城发	124229	13晋公投	124743	14银城投
122780	11长高新	124230	12蓉兴锦	124747	14太仓港
122781	11永州债	124234	13鹏铁01	124750	14宜春投
122787	11赣铁债	124236	12马经开	124751	14徐高铁
122788	11三明债	124238	13通辽投	124753	14海控01
122790	11诸暨债	124239	13鄞城投	124758	14吉安债
122792	11邯郸债	124241	13烟开发	124760	14余城投
122794	11海城债	124242	13营经开	124763	14昆交发
122795	pr诸城债	124243	13常高新	124768	14云城投
122796	11冀投01	124244	13番交投	124769	14合力01
122797	11冀投02	124245	13杭运河	124770	14合力02
122798	11泰矿债	124246	13溧城发	124771	14亳建投
122801	11焦作债	124247	13绍交投	124773	14温高02
122802	11辽阳债	124249	13大城投	124774	14通辽债
122804	11渭南01	124252	13邯交通	124777	14茂交投
122805	11大同债	124253	13新乡投	124782	14遵国投
122806	11渭南02	124254	13常熟发	124787	14荣经开
122813	11宁交通	124261	13鞍城投	124791	14孝城投
122814	11东营债	124264	13晋城投	124794	14合新02
122817	11三门峡	124265	13红河路	124797	14十二师
122819	11常城建	124266	13哈水投	124799	14京鑫融
122820	11潍东方	124268	13渝南发	124800	14金城债
122821	11吉城建	124277	13大丰港	124804	14津南债
122823	11舟山债	124280	13通经开	124805	14穗铁02
122825	11景德镇	124281	13石地产	124809	14龙国投
122826	11北港债	124283	13武新港	124811	14滇投债
122828	11抚州债	124284	13琼洋浦	124816	14顺德投
122830	11沈国资	124289	13丽城投	124817	14北国资
122833	11赣城债	124290	13长轨交	124820	14济高债
122834	11牡国投	124292	13溧城建	124821	14百色投
122835	11兴泸债	124294	13苏华靖	124822	14合滨投
122836	11盘锦债	124295	13宁铁路	124830	14桂铁投
122837	11武经发	124298	13临汾投	124831	14崇建设
122839	11鑫泰债	124299	13西经开	124834	14德城投
122840	11临汾债	124300	13云投控	124836	14大石桥
122844	11筑城投	124301	13日照债	124837	14赤城投
122846	11渝富债	124302	12桂交投	124839	14滨新塘
122847	11甬交投	124305	13瓦国资	124840	14漳九龙
122848	10桂林债	124308	13眉宏大	124842	14神木债
122849	11新余债	124310	13洪水利	124845	14晋开发
122851	10玉溪01	124311	13弘湘资	124851	14梧东泰
122852	10玉溪02	124312	13景德镇	124853	14淄城运
122854	11中汇债	124313	13苏家屯	124855	14淮城投
122858	10盐城01	124314	13筑铁路	124856	14常房债
122859	10盐城02	124315	13瓯交投	124857	14临桂新
122863	10榆城投	124317	13华发集	124858	14黄海港
122865	10苏海发	124318	13滨城投	124860	14汤建投
122866	10杭交投	124319	13昌国资	124862	14台基投
122867	11石城投	124321	13岳城投	124867	09绍交投
122871	10镇交投	124323	13新天治	124872	14杭拱墅
122873	10通经开	124325	13京生物	124877	14莱国资
122874	10红投01	124326	13郑建投	124878	14苏高新
122875	10红投02	124333	13铜城建	124879	14淮新02
122876	11海控债	124335	13海国资	124882	14江北嘴
122877	10渝南岸	124336	13渝地产	124883	14西永债
122881	10吴江债	124337	13铜建投	124884	14双水02
122882	10宁高新	124339	13渝城投	124886	14长农建
122885	10冀交通	124340	13张保债	124887	14盐城南
122886	10云投债	124342	13黔南资	124888	14邹城债
122888	10华靖债	124348	13京谷财	124890	14甘电投
122891	10通辽债	124357	13津房开	124893	14文登债
122892	10寿光债	124359	13三明投	124896	14北港债
122894	10洪市政	124361	13京科城	124898	14津水务
122895	10德州债	124363	13郑投资	124899	14穗铁03
122896	10芜开债	124365	13昌润债	124900	14滨开债
122897	10襄投债	124367	13锡城发	124901	14虞城建
122898	10攀国投	124368	13郑交投	124907	14芜宜居
122899	10杨浦01	124371	14北辰发	124912	13锦州02
122902	10赤峰债	124379	13许投资	124914	14慈建投
122903	10盐东方	124381	09衡城投	124918	14沪南汇
122904	10长城投	124384	13雅发投	124927	14玉溪投
122905	10南昌债	124385	13龙岩汇	124930	14堰城投
122906	10芜投01	124387	13湛基投	124931	09晋交投
122908	10苏交通	124390	13葫岛01	124935	14冀建投
122909	10宜兴债	124391	13葫岛02	124937	14湖中兴
122911	10鞍城投	124394	13永城投	124953	09宁城建

海富通基金管理有限公司
2014年10月14日

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同的内容摘要

（上接B17版）

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金的收益与分配

（一）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、基金收益分配采用现金方式；

2、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

3、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到0.25%以上，方可进行收益分配；

4、本基金收益每年最多分配4次。每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5、若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介上公告。

（二）基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率、标的指数同期增长率。

基金收益评价日本基金基金净值增长率减去标的指数同期增长率等于或大于0.25%的，基金管理人可以进行收益分配。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100.00%；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去1乘以100.00%。精确到百分号内小数点后2位，百分号内小数点后第3位四舍五入。

期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算上述指标。

2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的可分配收益，并确定收益分配比例及收益分配数额。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（四）收益分配方案的确定、公告与实施

本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，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。

（五）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金的指数许可使用费；

4、基金上市费及年费；

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类中第4－10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金的投资

(一) 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%；

（2）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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前述限制；

（3）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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前述限制；

（4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（6）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（7）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（8）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（9）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（11）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述另有约定外，因证券、期货市场波动、标的指数成份债券调整、标的指数成份债券流动性限制、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

六、基金资产估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3） 交易所上市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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

（五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第4项进行估值时，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机构发送的数据错误等，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，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议的处理

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

海富通基金管理有限公司
2014年10月14日