# 华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务公告

公告送出日期:2020 年 5 月 16 日

1 公告基本信息

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 华泰保兴多策略 |
| 基金主代码 | 007586 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 7 月 5 日 |
| 基金管理人名称 | 华泰保兴基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |
| 基金注册登记机构名称 | 华泰保兴基金管理有限公司 |
| 公告依据 | 《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)、《华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称《招募说明书》)等 |
| 申购起始日 | 2020 年 5 月 20 日 |
| 赎回起始日 | 2020 年 5 月 20 日 |
| 转换转入起始日 | 2020 年 5 月 20 日 |
| 转换转出起始日 | 2020 年 5 月 20 日 |

注:(1)华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")

(2)华泰保兴基金管理有限公司(以下简称"本公司"或"基金管理人")

2 申购、赎回和转换业务的办理时间

(1)开放日

根据本基金《基金合同》、《招募说明书》的约定,本基金以定期开放的方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日(含该日)起或每一开放期结束之日次日(含该日)起 3 个月的期间内,本基金采取封闭运作模式。

每一个封闭期结束后,本基金即进入开放期,开放期的期限为自每个封闭期结束之日后第一个工作日(含该日)起一至二十个工作日,开放期的具体时间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

本基金的第三个封闭期为自 2020 年 2 月 20 日至 2020 年 5 月 19 日止。本基金第三次办理申购、赎回和转换业务的开放期为 2020 年 5 月 20 日至 2020 年 6 月 16 日,共二十个工作日。本基金第四个封闭期为自 2020 年 6 月 17 日起 3 个月后对应日的前一日(含该日),如该对应日不存在对应日期或为非工作日,则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购、赎回或其他业务,也不上市交易。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购、赎回和转换等业务的,基金管理人有权合理调整申购、赎回和转换等业务的办理期间并予以公告,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起,继续计算该开放期时间。

(2)开放时间

本基金开放期内,投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回和转换业务的具体时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的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、赎回和转换业务时除外。

《基金合同》生效后,若出现新的证券 / 期货交易市场、证券 / 期货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,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 申购业务

3.1 申购金额限制

通过基金管理人直销柜台办理基金申购业务的,首次申购的最低金额为单笔 100,000 元,追加申购的最低金额为单笔 10,000 元;已在直销机构有认购或申购过本基金管理人管理的任一基金(包括本基金)记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。本基金直销机构单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。其他销售机构接受申购申请的最低金额和业务规则以其他销售机构的规定为准。

3.2 申购费率

投资人可以多次申购本基金,申购费用按每笔申购申请单独计算,基金投资人申购基金份额时支付申购费用。

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

本基金申购费率如下:

| | 申购金额(含申购费) | 申购费率 |
|---|---|---|
| 申购费率 | 100 万元以下 | 1.50% |
| | 100 万元(含)至 300 万元 | 1.00% |
| | 300 万元(含)至 500 万元 | 0.60% |
| | 500 万元(含)以上 | 1,000 元 / 笔 |

持有本基金份额的投资人因红利再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

本基金对通过基金管理人直销柜台申购基金份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、职业年金计划、养老目标基金、个人税收递延型商业养老保险等产品。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人也将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人直销柜台申购本基金的养老金客户享受申购费率(含固定申购费)零折优惠。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3.3 其他与申购相关的事项

(1)在开放期内,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购业务申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购价格为该开放期下一开放日基金份额申购价格;但若投资人在该开放期最后一个开放日业务办理时间结束之后提出申购业务申请的,视为无效申请。

(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,具体规定请参见届时相关公告。

(3)基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整申购的金额的数量限制,基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上刊登公告。

(4)基金管理人在不违反法律法规的前提下,可以决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额,但最迟应在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

(5)基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金申购费率。

(6)当发生大额申购情形时,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。

4 赎回业务

4.1 赎回份额限制

赎回的最低份额为 10 份基金份额。

4.2 赎回费率

投资人赎回基金份额时收取赎回费用,赎回费用由投资人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.50%的赎回费,对持续持有期大于等于 7 日但少于 30 日的投资人收取 0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于等于 30 日但少于 3 个月的投资人收取 0.50%的赎回费,并将赎回费总额的 75%计入基金财产;对持续持有期大于等于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取 0.50%的赎回费,并将赎回费总额的 50%计入基金财产。其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金赎回费率如下:

| | 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|---|
| 赎回费率 | 7 日以内 | 1.50% |
| | 7 日(含)至 30 日 | 0.75% |
| | 30 日(含)至 6 个月 | 0.50% |
| | 6 个月(含)以上 | 0 |

上述"月"指的是 30 个自然日。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4.3 其他与赎回相关的事项

(1)最低保留余额的限制

每个工作日投资人在单个交易账户保留的本基金份额余额少于 10 份时,若当日该账户同时有基金份额减少类业务(如赎回、转换出等)被确认,则基金管理人有权将投资人在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。

(2)在开放期内,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出赎回业务申请且登记机构确认接受的,其基金份额赎回价格为该开放期下一开放日基金份额赎回价格;但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出赎回业务申请的,视为无效申请。

(3)基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整赎回的份额以及最低基金份额保留余额的数量限制,基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上刊登公告。

(4)基金管理人在不违反法律法规的前提下,可以决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额,但最迟应在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

(5)基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金赎回费率。

(6)当发生大额赎回情形时,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。

5 转换业务

5.1 转换费率

基金转换费用由转出与转入基金申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

(1)基金转换费用的具体计算公式如下:

1)转换费用=转出基金赎回费+基金转换申购补差费

2)转出基金赎回费

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

3)基金转换申购补差费

①当转出基金的申购费率<转入基金的申购费率时,补差费=转出净金额×转入基金的申购费率 /(1+转入基金的申购费率)-转出净金额×转出基金的申购费率 /(1+转出基金的申购费率)

②当转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率时,则补差费为 0。

转出净金额=转出金额-转出基金赎回费

养老金客户通过直销柜台办理转换业务的,补差费计算过程中转入基金和转出基金的申购费率(含固定申购费)享受零折优惠。

(2)转入净金额与转入份额的具体计算公式如下:

1)转入净金额=转出金额 - 转换费用

2)转入份额=转入净金额 / 转入基金当日基金份额净值

(3)基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金转换费率。

5.2 其他与转换相关的事项

1)转换业务规则

基金转换只能在同一销售机构办理,且该销售机构同时办理转出基金及转入基金的销售。

基金转换,以转换申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用"份额转换"的原则提交申请,基金转换遵循"先进先出"的原则。

投资者办理基金转换业务时,转出的基金必须处于可赎回状态,转入的基金必须处于可申购状态,已经冻结的基金份额不得申请基金转换。

2)办理时间

本基金开放期内,转换业务的申请受理时间与本公司管理的基金日常申购业务受理时间相同。具体办理规则请遵循销售机构的相关规定。本基金封闭期内不办理转换业务。

在开放期内,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出转换业务申请且登记机构确认接受的,其基金份额转换价格为该开放期下一开放日基金份额转换价格;但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出转换业务申请的,视为无效申请。

3)转换限额

投资者在办理转换业务时,单笔转出基金份额不得低于 10 份。

4)交易确认

转入的基金持有期自该部分基金份额登记于注册登记系统之日起开始计算。转入的基金在赎回或转出时,按照自基金转入确认日起至该部分基金份额赎回或转出确认日止的持有时段所适用的赎回费率档次计算其所应支付的赎回费。基金转换后可赎回的时间为自基金转入确认日起第 2 个工作日。

6 基金销售机构

6.1 场外销售机构

6.1.1 直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销柜台。

名称:华泰保兴基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 88 号 4306 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室
邮政编码:200120
法定代表人:杨平
成立时间:2016 年 7 月 26 日
联系人:王珊珊
电话:(021)80299058
传真:(021)60963577
客户服务电话:400-632-9090(免长途话费),(021)80210198
网址:www.ehuataifund.com

6.1.2 场外代销机构

本基金暂无场外代销机构。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销售本基金,并及时公告。

6.2 场内销售机构

无。

7 基金份额净值公告 / 基金收益公告的披露安排

《基金合同》生效后,在每个封闭期内,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开放期内,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。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规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。

8 其他需要提示的事项

(1)本基金不向个人投资者销售。

(2)本公告仅对本基金开放申购、赎回和转换业务的有关事项予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,敬请详细阅读同时发布在中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)和本基金管理人网站上的《华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新文件,投资人还可通过本基金管理人网站或相关销售机构查阅本基金相关法律文件或资料。

(3)对位于未开设销售网点地区的投资人及希望了解本基金其它有关信息的投资人,敬请通过本基金管理人的客户服务电话(400-632-9090,免长途话费)或网站(www.ehuataifund.com)查询相关事宜。

(4)有关本基金开放申购、赎回和转换业务的具体规定若有变化,本基金管理人届时将另行公告。

(5)风险提示: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将来表现。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在作出投资决策后,基金运营情况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。基金投资有风险,敬请投资人认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金相关法律文件,关注基金的投资风险,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

**华泰保兴基金管理有限公司**
2020 年 5 月 16 日

---

# 华泰保兴基金管理有限公司
# 关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告

根据华泰保兴基金管理有限公司(以下简称"本公司")与大连网金基金销售有限公司(以下简称 "大连网金")签署的基金销售和服务协议,该机构将自 2020 年 5 月 18 日起销售本公司旗下基金,投资者可以通过大连网金办理本公司旗下基金的账户开户、申(认)购、赎回、定投、转换等业务,且自 2020 年 5 月 18 日起投资者可参与该机构开展的费率优惠活动。现将有关事项公告如下:

一、适用基金范围

华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金(基金代码:004024)

华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金(基金代码:A 类 004374/C 类 004375)

华泰保兴货币市场基金(基金代码:A 类 004493/B 类 004494)

华泰保兴尊合债券型证券投资基金(基金代码:A 类 005159/C 类 005160)

华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(基金代码:A 类 005169/C 类 005170)

华泰保兴成长优选混合型证券投资基金(基金代码:A 类 005904/C 类 005905)

华泰保兴尊利债券型证券投资基金(基金代码:A 类 005908/C 类 005909)

华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:A 类 006385/C 类 006386)

华泰保兴健康消费混合型证券投资基金(基金代码:A 类 006882/C 类 006883)

华泰保兴安悦债券型证券投资基金(基金代码:007540)

二、费率优惠内容

自 2020 年 5 月 18 日起,投资者通过大连网金办理华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金(基金代码:004024)、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金(基金代码:A 类 004374/C 类 004375)、华泰保兴货币市场基金(基金代码:A 类 004493/B 类 004494)、华泰保兴尊合债券型证券投资基金(基金代码:A 类 005159/C 类 005160)、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(基金代码:A 类 005169/C 类 005170)、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金(基金代码:A 类 005904/C 类 005905)、华泰保兴尊利债券型证券投资基金(基金代码:A 类 005908/C 类 005909)、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:A 类 006385/C 类 006386)、华泰保兴健康消费混合型证券投资基金(基金代码:A 类 006882/C 类 006883)、华泰保兴安悦债券型证券投资基金(基金代码:007540)申购(含定投申购、转换转入)业务时,最低可享受 0.1 折申购费率优惠,具体折扣费率以大连网金规定为准。各基金原费率请详见各基金《基金合同》《招募说明书》(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内,如本公司新增通过销售的基金产品,则自该基金产品开放申(认)购当日起,将同时开通该基金上述费率优惠活动。

费率优惠期限以大连网金公告为准。

三、重要提示

1、本优惠活动仅适用于本公司在大连网金处于正常申购期的基金的前端收费模式的申购费(含定投申购费)、转换费及处于基金募集期的基金认购费,不包括基金赎回等其他业务的手续费。

2、费率优惠活动解释权归大连网金所有,有关优惠活动的具体规定如有变化,敬请投资者留意大连网金的有关公告。

3、费率优惠活动期间,业务办理的流程以大连网金的规定为准。

4、投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读各基金的《基金合同》《招募说明书》(更新)等法律文件。

四、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

| 机构名称 | 网址 | 客服热线 |
|---|---|---|
| 大连网金基金销售有限公司 | www.yibaijin.com | 4000-899-100 |
| 华泰保兴基金管理有限公司 | www.ehuataifund.com | 400-632-9090 |

五、风险提示

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责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将来表现。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在作出投资决策后,基金运营情况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。基金投资有风险,敬请投资人认真阅读《基金合同》《招募说明书》(更新)等基金相关法律文件,关注基金的投资风险,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

**华泰保兴基金管理有限公司**
2020 年 5 月 16 日

---

(上接 C1 版)

(110)上海朝阳永续基金销售有限公司
住所:浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室
办公地址:上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
法定代表人:廖冰
联系人:郑秋月
联系电话:021-802348888-6694
传真:021-80234898
客服电话:4006991888
公司网址:www.998fund.com

(111)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:北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法定代表人:钱昊旻
联系人:徐英
电话:010-59336539
传真:010-59336500
客服电话:4008-909-998

(112)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 1 幢 2 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
联系人:仲秋玥
电话:010-88066632
传真:010-63136184
客服电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com

(113)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号
办公地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第七幢 23 层 1 号 4 号
法定代表人:陶捷
联系人:陆锋
客户服务电话:4000279899
公司网址:www.buyfunds.cn

(114)和耕传承基金销售有限公司
住所:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
法定代表人:李淑慧
联系人:罗聪
客户服务电话:0371-85518396
公司网址:www.hgccpb.com

(115)徽商期货有限责任公司
住所:安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层,6 号楼 1、2 层
办公地址:安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层,6 号楼 1、2 层
法定代表人:吴国华
联系人:申倩倩
客户服务电话:4008878707
公司网址:www.hsqh.net

(116)北京微动利基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341
办公地址:北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341
法定代表人:季长军
联系人:何鹏
客户服务电话:400-819-6665
公司网址:www.buyforyou.com.cn

(117)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:冷飞
联系人:李娟
联系电话:021-50810687
客服电话:021-50810673
公司网址: www.wacaijijin.com

(118)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
联系人:宋楠
联系电话:021-20219988
客服电话:021-20292031
网址:https://www.wg.com.cn/

(119)北京加和基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404
法定代表人:徐福星
联系人:李美
电话:010-68292940
传真:010-68292964
客户服务电话:400-600-0030
网址:www.bzfunds.com

(120)北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址: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六号万通中心 D 座 21 层&28 层
法定代表人:蒋煜
联系人:刘聪慧 / 徐晓荣
电话:010-58170905/010-58170876
传真:010-58100800
客户服务电话:400-818-8866
网址:www.shengshiview.com.cn

(121)北京格上富信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
客户服务电话:400-066-8586
公司网址:www.igesafe.com

(122)北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
客户服务电话:400-100-3391
公司网址:http://www.dianyingfund.com/

(123)万家财富基金销售(天津)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
联系人:邵玉磊
客户服务电话:010-59013825
公司网址:http://www.wanjiawealth.com/

(124)深圳前海财厚基金销售有限公司
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:广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室
法定代表人:杨艳平
联系人:胡闻智
客户服务电话:400-128-6800
公司网址:www.caiho.cn

(125)东方财富证券股份有限公司
住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
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:陈宏
联系人:付佳
联系电话:021-23586603
客服电话:95357
公司网址:http://www.18.cn

(126)北京百度百盈基金销售有限公司
住所:北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦
办公地址:北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦
法定代表人:张旭阳
联 系 人:孙博超
电 话:010-61952703
客服电话: 95055-4
公司网址: www.baiyingfund.com

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。

(二)注册登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
法定代表人:杨皓鹏
总经理:杨皓鹏
成立日期:2004 年 3 月 18 日
电话:021-38429808
传真:021-68419525
联系人:周琳

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
法定代表人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、田卫红

(四)审计基金财产的会计师事务所
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 01-12 室
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58153000
联系人:徐艳
经办会计师:徐艳、蔺育化

四、基金的名称

中海稳健收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

在充分重视本金长期安全的前提下,力争为基金份额持有人创造较高的稳定收益。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以通过参与新股、可转债、可分离转债首发的投资方式来获取收益,提高基金收益水平。

本基金投资组合的资产配置:债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)不低于基金资产的 80%,股票、权证类资产不超过基金资产的 20%,权证资产占基金资产净值的 0-3%。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。

八、基金的投资理念

本基金的投资理念是基于宏观经济周期趋势性变化,进行自上而下的主动性投资。在规避风险的前提下,为投资者提供较高的稳定收益。

九、基金的投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。比较固定收益品种与一级市场申购预期收益率,确定进行一级市场申购的资产比例,进行大类资产配置。

本基金在进行新股申购时,将结合金融工程数量化模型,使用中海基金估值模型等方法评估股票的内在价值,充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果,对于拟发行上市新股(或增发新股)等权益类资产价值进行深入发掘。同时分析新股(或增发新股)等权益类资产融资规模、市场申购资金规模等条件,评估申购中签率水平,从而综合评估申购收益率,确定申购资金在不同品种之间、网上与网下之间的资金分配,对申购资金进行积极管理,制定相应申购策略以获取较好投资收益。

此外,为保证股票资产比例不超过基金资产的 20%,本基金在存在锁定期的交易品种所形成的股票资产合计达到基金资产净值的 10%时,将不再申购存在锁定期的交易品种。当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计达到基金资产净值的 18%时,将不再申购新股。

2、久期配置 / 期限结构配置

(1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。

利用中海宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据一定的收益率模型为各种固定收益投资品种进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。

(2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。

在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过 AAM 模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3、债券类别配置:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债、资产支持证券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

本基金对于投资品种信用等级的投资限制如下:国债、央行票据、政策性金融债无限制;企业债券、公司债券等信用债券投资范围限制为 AA 以上(含 AA)的投资品种,信用评级低于 AA 的信用债券不得投资。(本基金信用评级体系参见附录四)

4、做市策略:基于各个投资品种具体情况,自下而上的交易策略。

为增加投资者利益和改善交易所债券市场的流动性,本基金将根据自身持仓的公司债券的具体情况,对一些公司债券的交易采取做市策略。

为适应中国固定收益市场快速发展的环境,提高固定收益市场流动性,上海证券交易所建设了"固定收益电子信息平台",引入一级交易商做市机制。提高证券交易的效率和市场流动性,为国债等固定收益产品提供了高效、低成本的批发交易平台。

本基金将在上海证券交易所固定收益综合电子平台上选择公司债券进行双边报价。国内外各金融市场做市交易策略的实证研究表明,做市交易策略可获得稳定的收益回报。

因此,本基金对于部分公司债券采取做市策略交易,一方面可以实现一定利润;另一方面可以增加公司债券的流动性。

5、其它交易策略

(1)短期资金运用:在短期资金运用上,如果逆回购利率较高,选择逆回购融出资金。

(2)公司债跨市场套利:

公司债将在银行间市场和交易所市场同时挂牌,根据以往的经验,两个市场的品种将出现差价套利交易的机会。随着交易所固定收益综合电子平台的推出,交易所债券市场流动性日益增强,这使得跨市场套利策略成为可能。本基金将利用两市场相同公司债券交易价格的差异,锁定其中的无风险收益进行跨市场套利,增加持有人收益。

十、基金的投资限制

1、本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%。

(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

(3)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%。

(4)本基金不得在二级市场买入权证。在一级市场申购可分离转债所持有的权证只能单向卖出,不得买入。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定。

(5)现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(6)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%。

(7)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%。

(8)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%。

(9)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(10)本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具。

(11)因通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计低于基金净值的 20%。

(12)本基金不得在二级市场买入股票。

(13)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、上市公司股票停牌、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。

(14)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。

(15)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

(16)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。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》的有关约定。

除上述第 5)、13)、14)项另有规定外,由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。其中因交易品种存在锁定期的原因,当通过发行市场申购、可转债转股所形成的股票资产合计超过基金净值的 20%,基金管理人将在相关交易品种锁定期满后 10 个交易日内调整,以达到标准。法律法规、监管部门另有规定的从其规定。

2、为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券。

(2)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,但法律法规或中国证监会另有规定的除外。

(5)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。

(6)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。

(7)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。

(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中国债券总指数收益率×100%。中国债券总指数由中央债券登记结算中心于 2003 年 1 月 1 日编制发布,样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债(固定、浮动利率)、金融债。中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)上公开发布。

本基金选择中国债券总指数作为业绩比较基准的原因如下:

第一,从投资范围看,本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债等债券。而中国债券总指数是目前涵盖范围最广的公开指数,涵盖了中国债券市场整体价格和投资回报情况;且指数样本是采集市场上真正在交易品种所制定出来的,有利于基金管理人以此总指数为基准进行投资组合的配置。迄今为之,这一指数已经为包括社保基金和许多债券基金在内的很多机构采用,而且使用范围正不断扩大。

第二,从发布主体看,中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债、企业债和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构,是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构,是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。因此从发布主体上保证中国债券总指数比较客观和专业。

第三,从编制规则看,中债总指数在样本券选择上使用合理的双边报价、合理和结算价、跨公司债券价格处理等价格源,且具有财富、全价、净价三组总值,指数按待偿期分段提供了 12 个指标值为一组的多组指标值。因此中债总指数的编制规则较为全面科学。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金属债券型证券投资基金,为证券投资基金中的较低风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金,高于货币市场基金。

十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合报告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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据为截至 2020 年 3 月 31 日报告期末的第三季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

截至 2020 年 3 月 31 日,中海稳健收益债券型证券投资基金资产净值为 114,392,437.22 元,基金份额净值为 1.139 元,累计基金份额净值为 1.729 元。其资产组合情况如下:

| 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 | 123,965,183.53 | 89.54 |
| | 其中:债券 | 123,965,183.53 | 89.54 |
| | 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 | 1,500,000.00 | 1.08 |
| | 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 | 10,934,897.33 | 7.90 |
| 8 | 其他资产 | 2,045,049.97 | 1.48 |
| 9 | 合计 | 138,445,130.83 | 100.00 |

2、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。

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。

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 | 5,625,334.60 | 4.92 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 15,505,930.40 | 13.56 |
| | 其中:政策性金融债 | 15,505,930.40 | 13.56 |
| 4 | 企业债券 | 18,195,378.10 | 15.91 |
| 5 | 企业短期融资券 | 40,143,000.00 | 35.09 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 44,495,540.43 | 38.90 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 123,965,183.53 | 108.37 |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 018008 | 国开 1802 | 119,280 | 12,486,230.40 | 10.92 |
| 2 | 011901785 | 19 南京地铁 SCP004 | 100,000 | 10,049,000.00 | 8.78 |
| 3 | 011902385 | 19 厦路桥 SCP006 | 100,000 | 10,037,000.00 | 8.77 |
| 4 | 011902088 | 19 海通恒信 SCP005 | 100,000 | 10,032,000.00 | 8.77 |
| 5 | 011902830 | 19 厦翔业 SCP009 | 100,000 | 10,025,000.00 | 8.76 |

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期期末未持有国债期货合约。

(3)本期国债期货投资评价

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

10、投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2)报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3)截至 2020 年 3 月 31 日,本基金的其他资产项目构成如下:

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 4,030.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | 463,996.20 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,561,479.27 |
| 5 | 应收申购款 | 15,543.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,045,049.97 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转债明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 132015 | 18 中油 EB | 8,537,607.00 | 7.46 |
| 2 | 132013 | 17 宝武 EB | 6,068,405.00 | 5.30 |
| 3 | 110053 | 苏银转债 | 1,772,286.00 | 1.55 |
| 4 | 127005 | 长证转债 | 1,376,573.60 | 1.20 |
| 5 | 132009 | 17 中油 EB | 1,208,880.00 | 1.06 |
| 6 | 110057 | 现代转债 | 1,147,368.80 | 1.00 |
| 7 | 127012 | 招路转债 | 1,082,016.36 | 0.95 |
| 8 | 132007 | 16 凤凰 EB | 1,020,000.00 | 0.89 |
| 9 | 128075 | 远东转债 | 929,832.00 | 0.81 |
| 10 | 113025 | 明泰转债 | 906,265.80 | 0.79 |
| 11 | 113021 | 中信转债 | 889,700.00 | 0.78 |
| 12 | 110045 | 海澜转债 | 821,440.00 | 0.72 |
| 13 | 113022 | 浙商转债 | 809,200.00 | 0.71 |
| 14 | 113534 | 鼎胜转债 | 807,757.70 | 0.71 |
| 15 | 128067 | 一心转债 | 720,244.38 | 0.63 |
| 16 | 132008 | 17 山高 EB | 648,945.00 | 0.57 |
| 17 | 113011 | 光大转债 | 644,050.00 | 0.56 |
| 18 | 110048 | 福能转债 | 586,250.00 | 0.51 |
| 19 | 113508 | 新凤转债 | 452,721.60 | 0.40 |
| 20 | 110058 | 永鼎转债 | 430,730.00 | 0.38 |
| 21 | 113014 | 林洋转债 | 425,840.00 | 0.37 |
| 22 | 113017 | 吉视转债 | 396,529.00 | 0.35 |
| 23 | 128065 | 雅化转债 | 394,574.22 | 0.34 |
| 24 | 110033 | 国贸转债 | 390,985.00 | 0.34 |
| 25 | 127006 | 敖东转债 | 389,806.89 | 0.34 |
| 26 | 110043 | 无锡转债 | 382,842.40 | 0.33 |
| 27 | 110051 | 中天转债 | 352,410.00 | 0.31 |
| 28 | 110042 | 航电转债 | 340,866.00 | 0.30 |
| 29 | 128032 | 双环转债 | 340,547.13 | 0.30 |
| 30 | 110047 | 山鹰转债 | 339,150.00 | 0.30 |
| 31 | 113519 | 长久转债 | 333,090.00 | 0.29 |
| 32 | 113504 | 艾华转债 | 323,797.60 | 0.28 |
| 33 | 113012 | 骆驼转债 | 298,794.40 | 0.26 |
| 34 | 128045 | 机电转债 | 294,576.00 | 0.26 |
| 35 | 113013 | 国君转债 | 294,075.00 | 0.26 |
| 36 | 113525 | 台华转债 | 283,218.00 | 0.25 |
| 37 | 128071 | 合兴转债 | 242,191.25 | 0.21 |
| 38 | 128028 | 赣锋转债 | 218,435.00 | 0.19 |
| 39 | 128035 | 大族转债 | 215,460.00 | 0.19 |
| 40 | 128058 | 拓邦转债 | 121,795.24 | 0.11 |
| 41 | 123004 | 铁汉转债 | 109,530.00 | 0.10 |
| 42 | 113544 | 桃李转债 | 106,921.50 | 0.09 |
| 43 | 113542 | 好客转债 | 66,984.00 | 0.06 |
| 44 | 123023 | 迪森转债 | 20,073.50 | 0.02 |
| 45 | 110056 | 亨通转债 | 18,246.00 | 0.02 |
| 46 | 132012 | 17 巨化 EB | 17,391.00 | 0.02 |
| 47 | 110052 | 贵广转债 | 11,875.00 | 0.01 |

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

十四、基金的业绩

本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。基金业绩数据截至 2020 年 3 月 31 日。

基金本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2008.04.10-2008.12.31 | 11.79% | 0.18% | 11.28% | 0.23% | 0.51% | -0.05% |
| 2009.01.01-2009.12.31 | 6.56% | 0.24% | -1.24% | 0.10% | 7.80% | 0.14% |
| 2010.01.01-2010.12.31 | 8.54% | 0.21% | 1.92% | 0.10% | 6.62% | 0.11% |
| 2011.01.01-2011.12.31 | -3.23% | 0.24% | 5.72% | 0.11% | -8.95% | 0.13% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | 5.82% | 0.13% | 2.51% | 0.07% | 3.31% | 0.06% |
| 2013.01.01-2013.12.31 | 2.38% | 0.14% | -2.10% | 0.11% | 4.48% | 0.03% |
| 2014.01.01-2014.12.31 | 16.48% | 0.27% | 11.23% | 0.15% | 5.25% | 0.12% |
| 2015.01.01-2015.12.31 | 10.93% | 0.34% | 8.03% | 0.11% | 2.90% | 0.23% |
| 2016.01.01-2016.12.31 | -1.75% | 0.13% | 1.30% | 0.12% | -3.05% | 0.01% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | -0.79% | 0.08% | -1.18% | 0.09% | 0.39% | -0.01% |
| 2018.01.01-2018.12.31 | 4.49% | 0.11% | 9.63% | 0.11% | -5.14% | 0.00% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 7.25% | 0.11% | 4.36% | 0.08% | 2.89% | 0.03% |
| 2020.1.1-2020.3.31 | 1.33% | 0.24% | 3.51% | 0.17% | -2.18% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 93.86% | 0.20% | 69.27% | 0.12% | 24.59% | 0.08% |

十五、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费。

5、基金份额持有人大会费用。

6、基金的证券交易费用。

7、基金的银行汇划费用。

8、基金的销售服务费。9、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。

本基金合同终止、基金财产清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.6%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 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 2‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×2‰÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

本基金的销售服务费年费率为 0.35%,本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H 为基金每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 3-9 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。

(四)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,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用。

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。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

(六)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。

十六、对招募说明书更新部分的说明

(一)在"基金管理人"部分,对"主要人员情况"进行了更新。

(二)对"基金托管人"部分进行了更新。

(三)对"相关服务机构"部分进行了更新。

(四)在"基金份额的申购和赎回"部分,对"申购与赎回的数额限制"部分进行了更新。

(五)在"基金的投资"部分,对"基金投资组合报告"按最新资料进行了更新。

(六)对"基金的业绩"按最新资料进行了更新。

(七)在"其他应披露的事项"部分,披露了本期间本基金的公告信息。

**中海基金管理有限公司**
二〇二〇年五月十六日