

中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）
上市交易公告书

基金管理人：中海基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2016 年 3 月 3 日
公告日期：2016 年 2 月 29 日

目 录

一、	重要声明与提示.....	3
二、	基金概览	3
三、	基金的历史、转型、日常申赎与上市交易	4
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人	6
五、	基金主要当事人简介	8
六、	基金合同摘要	12
七、	基金财务状况（未经审计）	12
八、	基金投资组合	14
九、	重大事项揭示	16
十、	基金管理人承诺.....	16
十一、	基金托管人承诺.....	16
十二、	备查文件目录.....	17
	附件：基金合同摘要	18

一、重要声明与提示

中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《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>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报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。

本基金托管人保证本公告书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、深圳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。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅本基金管理人 2016 年 2 月 20 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本基金管理人网站（www.zhfund.com）的本基金更新招募说明书。

二、基金概览

- 1、基金名称：中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)
基金简称：中海惠裕债券发起式(LOF)
场内简称：中海惠裕
- 2、交易代码：163907
- 3、基金份额总额：577,206,466.96 份（截至 2016 年 2 月 25 日）
- 4、基金份额净值：1.012 元（截至 2016 年 2 月 25 日）
- 5、本次上市交易的基金份额总额：152,771,251.00 份（截至 2016 年 2 月 25 日）
- 6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 7、上市交易日期：2016 年 3 月 3 日
- 8、基金管理人：中海基金管理有限公司

9、基金托管人：招商银行股份有限公司

10、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

11、本公司基金从业人员持有基金份额的总量及占该只基金总份额的比例

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
本公司基金从业人员持有中海惠裕份额	427,700.66	0.07%

12、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间

项目	持有份额总数的数量区间
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有中海惠裕份额	0至10（含）万份

13、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间

项目	持有份额总数的数量区间
本基金的基金经理持有中海惠裕份额	0份

三、基金的历史、转型、日常申赎与上市交易

（一）本基金的历史

中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）由中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金分级期届满转换而成。

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1448号

2、基金管理人：中海基金管理有限公司

3、基金托管人：招商银行股份有限公司

4、基金合同的生效：基金管理人于2013年1月7日获得中国证监会书面确认，《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模1,730,836,201.13份。

（二）本基金的转型

根据基金合同的有关规定，基金合同生效后3年期届满，本基金无需召开基

金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）”。惠裕A和惠裕B以各自的基金份额净值为基准转换为中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）的基金份额。本基金管理人于2015年11月19日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及中海基金管理有限公司网站上刊登了《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满与基金份额转换的公告》。

本基金管理人于2016年1月7日对中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金进行了3年分级届满后的转换工作。份额转换结果如下表：

转换前的基金份额	转换前份额净值（元）	转换前份额数(份)	转换比例	转换后的基金份额	转换后份额数(份)
惠裕 A	1.017220319	25131255 .60	1.017220319	中海惠裕 纯债债券 (LOF)	25,564,023. 84
惠裕 B	1.262403385	51920562 9.88	1.262403385	中海惠裕 纯债债券 (LOF)	655,446,944 .59

本基金管理人已根据合同约定，对惠裕A、惠裕B的份额持有人的基金份额进行了计算，并由本基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。本基金管理人于2016年1月9日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及中海基金管理有限公司网站上发布了《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果的公告》。

（三）本基金的日常申购、赎回

本基金管理人自2016年1月15日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

（四）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：深圳证券交易所深证上【2016】

- 2、上市交易日期：2016年3月3日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易
- 4、基金场内简称：中海惠裕
- 5、交易代码：163907
- 6、本次上市交易份额：152,771,251.00份（截至2016年2月25日）
- 7、基金资产净值及份额参考净值的披露：开放式基金每个交易日交易结束后对基金资产净值进行的估值。基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个交易日交易结束后将经过基金托管人复核的中海惠裕的基金份额参考净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。
- 8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

（五）本基金转托管的主要内容

基金份额持有人自2016年2月29日起可以开始办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2016年2月25日的中海惠裕场内基金份额持有情况：

- 1、场内基金份额持有人户数：154户；场外基金份额持有人户数：897户；
- 2、中海惠裕总份额：577,206,466.96份；其中场内份额152,771,251.00份，平均每户持有的场内基金份额：992,021.11份；其中场外份额424,435,215.96份，平均每户持有的场内基金份额：473,171.92份
- 3、场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有146,011,689.00份，占95.5754%；场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：个人持有6,759,562.00份，占4.4246%
- 4、场外机构投资者持有的基金份额及占场外基金总份额比例：机构持有

372,406,750.53份，占87.7417%；场外个人投资者持有的基金份额及占场外基金总份额比例：个人持有 52,028,465.43份，占12.2583%

5、场内基金前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	中国太平洋财产保险-传统-普通 保险产品-013C-CT001 深	22,661,913.00	14.83%
2	九泰基金-兴业银行-兴业银行股 份有限公司深圳分行	21,277,896.00	13.93%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公 司-传统-普通保险产品	14,273,666.00	9.34%
4	太平洋资管-农业银行-卓越财富 债基增强型产品	11,373,059.00	7.44%
5	中国船舶工业集团公司企业年 金计划-中信银行股份有限公司	8,239,726.00	5.39%
6	宁波鼎锋海川投资管理中心（有 限合伙）鼎锋另类策略 2 期证券 投资基金	6,602,841.00	4.32%
7	中国太保集团股份有限公司-本 级-集团自有资金-012G-ZY001 深	6,217,710.00	4.07%
8	平安大华基金-平安银行-平安大 华固定收益增强六号特定客户资 产管理计划	5,459,895.00	3.57%
9	哈尔滨铁路局企业年金计划-中 国工商银行股份有限公司	5,328,733.00	3.49%
10	平安大华基金-平安银行-平安大 华固定收益增强七号特定客户资 产管理计划	5,147,324.00	3.37%
合计		106,582,763.00	69.77%

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

- 1、名称：中海基金管理有限公司
- 2、法定代表人：黄鹏
- 3、总经理：黄鹏
- 4、注册资本：人民币壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元
- 5、注册地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
- 6、设立批准文号：证监基金字[2004]24号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000086780（市局）
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的凭证许可经营)
- 9、存续期间：持续经营
- 10、股东及其出资比例：中海信托股份有限公司出资6100万元人民币，占注册资本41.591%；国联证券股份有限公司出资4900万元人民币，占注册资本33.409%；法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司出资3666.67万元人民币，占注册资本25.000%。

11、内部组织结构及职能：

公司设有二中心、十二部门、一分公司，即投研中心、营销中心、资产管理一部、资产管理二部、风控稽核部、互联网金融部、战略发展部、品牌与公共关系部、信息技术部、基金事务部、交易部、综合管理部、财务与固有资金管理部、人力资源部及北京分公司。随着业务发展的需要，公司将对业务部门进行适当调整。

投研中心下设投资、研究、金融工程三个小组，负责权益类及固定收益类证券的投资，宏观、策略、权益类及固定收益类证券的研究，量化投资及金融工程研究。

营销中心下设销售、客户服务二个小组，负责各类产品的线下销售、及客户售前、售后服务。

资产管理一部、资产管理二部负责特定客户的资产管理。

风控稽核部负责公司各项业务事前、事中风险的控制及各项业务事后的监督、稽核及整改措施的落实。

互联网金融部负责公司各类产品线上销售及推广。

战略发展部负责公司整体战略规划、产品研发。

品牌与公共关系部负责公司市场推广、品牌策划。

信息技术部负责公司信息系统的开发及维护。

基金事务部负责公司基金登记注册、直销服务、会计核算、资金清算。

交易部负责公司交易指令的执行。

综合管理部负责公司日常行政保障事务。

财务与固有资金管理部负责公司自有资金的投资、日常财务事务。

人力资源部负责公司人力资源管理。

北京分公司负责与监管部门、驻京托管及代销机构总部的联络，配合公司营销计划的实施。

12、人员情况：

截至2015年2月19日，本公司共有员工121人，获得基金从业资格的有115人。基金管理人无任何受处罚记录。

13、信息披露负责人及咨询电话：王莉，021-38429808

14、基金管理业务情况简介：

截至2015年2月19日，本公司旗下共管理30只基金，分别为中海优质成长证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、中海能源策略混合型证券投资基金、中海稳健收益债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中海量化策略混合型证券投资基金、中海上证50指数增强型证券投资基金、中海货币市场证券投资基金、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、中海增强收益债券型证券投资基金、中海消费主题精选混合型证券投资基金、中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）、中海可转换债券债券型证券投资基金、中海医疗保健主题股票型证券投资基金、中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金、中海安鑫保本混合型证券投资基金、中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、中海纯债债券型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金。

投资基金、中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金、中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金、中海中证高铁产业指数分级证券投资基金、中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金、中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金。

15、本基金基金经理：

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江小震	固定收益部总经理、中海增强收益债券型证券投资基金基金经理、中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）基金经理、中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理、中海惠祥分级债券型证券投资基金基金经理、中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年1月7日	-	17年	复旦大学金融学专业硕士。历任长江证券股份有限公司投资经理、中维资产管理有限责任公司部门经理、天安人寿保险股份有限公司（原名恒康天安保险有限责任公司）投资部经理、太平洋资产管理有限责任公司高级经理。2009年11月进入本公司工作，历任固定收益小组负责人、固定收益部副总监，现任固定收益部总经理。2010年7月至2012年10月任中海货币市场证券投资基金基金经理，2011年3月至今任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理，2013年1月至今任中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）基金经理，2014年3月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理，2014年8月至今任中海惠祥分级债券型证券投资基金基金经理，2016年2月至今任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国

农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

3、基金托管业务经营情况

截至2015年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管151只开放式基金及其它托管资产，托管资产为71,557.79亿元人民币。

（三）基金验资机构

名称：江苏公证天业会计师事务所有限公司

住所：无锡市新区开发区旺庄路生活区

办公地址：无锡市梁溪路28号

法定代表人：张彩斌

联系电话：0510-85888988 85887801

传真：0510-85885275

联系人：华可天

经办注册会计师：夏正曙、华可天

六、基金合同摘要

基金合同摘要请参见附件。

七、基金财务状况（未经审计）

（一）基金募集期间费用

深圳证券交易所在基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金募集结束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 2015 年 2 月 25 日, 本基金资产负债表如下:

单位: 人民币元

资产	本期末 2015 年 2 月 25 日
资产:	
银行存款	5,873,235.32
结算备付金	4,840,491.40
存出保证金	16,979.71
交易性金融资产	780,431,534.10
其中: 股票投资	—
基金投资	—
债券投资	780,431,534.10
资产支持证券投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	5,000,000.00
应收利息	15,969,250.04
应收股利	—
应收申购款	192,186.19
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	812,323,676.76
负债和所有者权益	
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	221,000,000.00
应付证券清算款	—
应付赎回款	6,649,577.96
应付管理人报酬	280,182.92
应付托管费	80,052.24
应付销售服务费	—
应付交易费用	23,291.18
应交税费	—
应付利息	14,987.36
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	87,431.78
负债合计	228,135,523.44

所有者权益：	
实收基金	452, 450, 467. 94
未分配利润	131, 737, 685. 38
所有者权益合计	584, 188, 153. 32
负债和所有者权益总计	812, 323, 676. 76

注：报告截至日 2016 年 2 月 25 日，中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）份额净值 1.012 元，基金份额总额 577, 206, 466. 96 份。

八、基金投资组合

截至 2016 年 2 月 25 日，中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

（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	固定收益投资	780, 431, 534. 10	96. 07
	其中：债券	780, 431, 534. 10	96. 07
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	10, 713, 726. 72	1. 32
6	其他资产	21, 178, 415. 94	2. 61
7	合计	812, 323, 676. 76	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	30, 993, 800. 00	5. 31
2	央行票据	—	—

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	644,691,734.10	110.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	104,746,000.00	17.93
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	780,431,534.10	133.59

(五) 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	124240	13合工投	600,970	61,869,861.50	10.59
2	118085	11晨鸣控股债	500,000	52,505,000.00	8.99
3	124209	PR三门峡	600,000	50,406,000.00	8.63
4	124131	PR安国资	600,000	50,124,000.00	8.58
5	1280467	12湖州城投债	500,000	42,785,000.00	7.32

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,979.71

2	应收证券清算款	5,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	15,969,250.04
5	应收申购款	192,186.19
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,178,415.94

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。

九、重大事项揭示

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

(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、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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专

门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

(一)中国证监会核准中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金募集的文件;

(二)《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同》;

(三)《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金托管协议》;

(四)《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金招募说明书》;

(五)《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金分级运作期届满转型后基金名称变更及转换基准日等事项的公告》;

(六)法律意见书;

(七)基金管理人业务资格批件和营业执照;

(八)基金托管人业务资格批件和营业执照;

(九)中国证监会要求的其他文件。

存放地点:基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式:基金投资者可在营业时间免费查阅,或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站(www.zhfund.com)查阅。

中海基金管理有限公司

二〇一六年二月二十九日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- 1、分享基金财产收益；
 - 2、参与分配清算后的剩余基金财产；
 - 3、依法申请赎回其持有的基金份额；
 - 4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；
 - 5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
 - 6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
 - 7、监督基金管理人的投资运作；
 - 8、对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
 - 9、法律法规和基金合同规定的其他权利。
- 每份基金份额具有同等的合法权益。

（二）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 5、执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6、返还基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 7、发起资金提供方持有认购的基金份额不少于3年；
- 8、法律法规和基金合同规定的其他义务。

（三）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- 2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 3、发售基金份额；
- 4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- 6、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 8、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- 9、自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 10、选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 11、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 13、依法召集基金份额持有人大会；
- 14、法律法规和基金合同规定的其他权利。

（四）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或

- 配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
 - 18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
 - 19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
 - 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
 - 21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
 - 22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
 - 23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
 - 24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
 - 25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
 - 26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
 - 27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（五）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- 1、依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 2、监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3、自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- 4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- 5、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损

失的情形，应及时呈报中国证监会；

- 6、依法召集基金份额持有人大会；
- 7、按规定取得基金份额持有人名册资料；
- 8、法律法规和基金合同规定的其他权利。

（六）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- 1、安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 8、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 10、按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- 13、按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎

回款项；

16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18、基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21、执行生效的基金份额持有人大会决议；

22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23、建立并保存基金份额持有人名册；

24、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

基金合同生效之日起 3 年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由惠裕 A、惠裕 B 基金份额持有人独立进行表决。惠裕 A、惠裕 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有平等的投票权；基金合同生效后 3 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；
(3) 更换基金托管人；
(4) 转换基金运作方式（但基金合同生效后 3 年期届满时转为上市开放式基金（LOF）除外）；
(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
(6) 变更基金类别；
(7) 本基金与其他基金的合并；
(8) 变更基金投资目标、范围或策略；
(9) 变更基金份额持有人大会程序；
(10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
(11) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

基金合同生效之日起 3 年内，单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有惠裕 A 和惠裕 B 各自基金份额分别合计不少于该级基金总份额的 10%（含 10%）”，下同。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和销售服务费；
(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率；
(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
(6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基

金管理人召集；

- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。
- 4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。
- 5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。
- 6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

- 1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：
 - (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
 - (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会会议程：

- (1) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，

有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

基金合同生效之日起 3 年内，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）或类似表述均指“有效的惠裕 A 和惠裕 B 各自的基金份额分别合计不少于在权益登记日该级基金总份额的 50%（含 50%）”，下同。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

（3）召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

（4）本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）以上；

（5）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

（6）会议通知公布前报中国证监会备案。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上（含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

基金合同生效之日起 3 年内，出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）或类似表述均指“出席大会的惠裕 A 和惠裕 B 各自的基金份额持有人和代理人所持该级基金份额表决权的 50%以上（含 50%）”，下同。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式（但基金合同生效后 3 年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外）、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分

开审议、逐项表决。

6、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

基金合同生效之日起3年内，参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上（含2/3）或类似表述均指“参加大会的惠裕A和惠裕B各自的基金份额持有人或其代理人所持该级基金份额表决权的2/3以上（含2/3）”，下同。

（七）计票

1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进

行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、本基金基金合同生效之日起3年内，基金收益分配原则：

- (1) 本基金基金合同生效后 3 年内，本基金不进行收益分配；
- (2) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、本基金基金合同生效后 3 年期届满，转换为上市开放式基金（LOF）后，基金收益分配原则：

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式：场外基金份额的收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金

分红；

场内基金份额的收益分配方式只能为现金分红，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和注册登记机构的相关规定；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（三）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体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（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

（四）基金收益分配中发生的费用

本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，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

(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、基金销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市初费和上市月费；
- 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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起 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、休息日，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 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起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、基金销售服务费

基金合同生效之日起3年内，惠裕A的销售服务费年费率为0.35%，惠裕B不收取销售服务费。

惠裕A销售服务费按前一日惠裕A基金资产净值的0.35%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H为惠裕A每日应计提的销售服务费

E为惠裕A前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金合同生效后3年期届满自动转换为“中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）”后，不再收取销售服务费。

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、基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用等相关费用；

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)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 个工作日前在指定媒体上刊登公告。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

基金合同生效之日起3年内以及基金合同生效后3年期届满并转换为上市开放式基金（LOF）后，基金的投资相关内容将保持不变。如法律法规或监管部门的相关规定发生变化的，本基金履行适当程序后，基金投资的相关内容可随之改变并及时公告。

（一）投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可分离交易可转债中的公司债部分、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、地方政府债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具以及经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）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中小企业私募债券的比例不高于基金资产净值的 20%，现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

（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）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；

- (2) 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%；
- (3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5) 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%；
- (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；
- (10) 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%；
- (11) 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%；
- (12) 本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的中小企业私募债券的剩余期限不得超过惠裕 B 的剩余封闭运作期；
- (13) 本基金投资不得违反法律法规、监管部门及基金合同规定的其他限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。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。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，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。

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) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(二) 基金资产净值的公告方式

1、基金合同生效之日起 3 年内

基金合同生效后，在惠裕 A 的首次开放日或者惠裕 B 上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及惠裕 A 和惠裕 B 的基

金份额参考净值。

在惠裕 A 的首次开放或者惠裕 B 上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值及基金份额累计净值、惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值以及惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值、惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

2、基金合同生效后 3 年期届满

基金合同生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（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经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

- (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、本基金合同生效满三年之日，基金资产规模低于 2 亿元的；
 - 4、《基金合同》约定的其他情形；
 - 5、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)对基金财产进行分配。
 - 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（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

若基金合同生效之日起 3 年内，本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足惠裕 A 的本金及应计收益分配，剩余部分（如有）由惠裕 B 的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

若基金合同生效后 3 年期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后发生基金财产清算的情形，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、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决

是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制为册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。