

中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要 （2017年第2号）

本基金基金合同于2013年1月7日生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

《中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2013年1月7日生效，根据基金合同的有关规定，中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同生效满三年后，本基金无需召开基金份额持有人大会，即转换为上市开放式基金（LOF）。本基金现已转换为上市开放式基金（LOF），基金名称已变更为“中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）”，基金代码为“163907”。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2017年7月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

本基金管理人为中海基金管理有限公司，基本信息如下：

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

邮政编码：200120

成立日期：2004年3月18日

法定代表人：黄鹏

总经理：黄鹏

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。

【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]24号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

存续期间：持续经营

联系人：葛玮赓

联系电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司	41.591%
------------	---------

国联证券股份有限公司	33.409%
------------	---------

法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	25.000%
-------------------	---------

（二）主要人员情况

1、董事会成员

黄晓峰先生，董事长。中国人民大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁、党委书记。历任湖北省计划管理干部学院助教，国家海洋局管理司主任科员，中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主管，中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监，中海石油财务有限责任公司总经理。

庞建先生，董事。中国人民大学本科毕业，高级会计师。现任中国海洋石油总公司资金部总经理。历任渤海石油公司对外合作部计划财务部外事会计，渤海13/03合作区联管会财务专业代表，10/15、11/19、06/17合作区联管会财务专业代表，中国海洋石油总公司审计部干部，中海会计审计公司第

三业务处干部、审计业务三部经理（副处级），中国海洋石油总公司（有限公司）审计部审计三处处长、项目审计经理、审计监察部投资项目审计调查经理、内审岗经理，中国海洋石油有限公司审计监察部总经理，中国海洋石油总公司（有限公司）审计监察部副总经理兼审计中心主任，中国海洋石油国际有限公司副总经理。

黄鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司总经理兼中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员，中海基金管理有限公司董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司总裁、董事，兼华英证券有限责任公司董事。历任无锡市证券公司（国联证券前身）交易员，国联证券有限责任公司投资经理，无锡市国联投资管理咨询有限公司投资经理，锡洲国际有限公司投资部经理，中海基金管理有限公司投资管理部总经理兼投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司证券投资部总经理、副总裁。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司监事会主席。历任国联证券股份有限公司证券投资部经理、证券营业部总经理、财富管理中心总经理、资产管理部总经理、总裁助理、副总裁。

MOLING CHEN（陈末翎）女士，董事。澳大利亚国籍。澳洲莫纳什大学工商管理硕士。现任爱德蒙罗斯柴尔德中国私募股权基金I期和II期主管合伙人。历任澳大利亚墨尔本药物技术研究所化学分析师，澳大利亚墨尔本凯龙生物区域经理，百奥维达中国基金高级投资总监。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所博士。现任国务院发展研究中心金融研究所副所长。曾任中关村证券公司总裁助理、国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。

WANG WEIDONG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。

北京市中伦律师事务所合伙人，历任Sidley Austin(盛德律师事务所)芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人，美国德杰律师事务所合伙人。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师、教育部重点研究基地中国社会主义市场经济研究中心主任。历任复旦大学经济学院助教、讲师，复旦大学经济学院副教授。

2、监事会成员

张悦女士，监事长。硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司总稽核、党办主任、信托事务管理总部总经理。历任北京石油交易所交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油有限公司上海分公司计财部岗位经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理、稽核审计部经理、纪委副书记、合规总监。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学金融系硕士、法国国立电信管理学院金融系硕士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理(香港)有限公司董事会成员、执行总监、营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员，爱德蒙得洛希尔集团亚太区财务长。历任法国巴黎银行全球IT部门客户经理、法国巴黎银行新加坡分行项目经理、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司财务总监、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员。

康铁祥先生，职工监事。博士。现任中海基金管理有限公司风控稽核部总经理。历任山东省招远市绣品厂财务科科员，上海浦发银行外汇业务部科员，中海基金管理有限公司风险管理部助理风控经理、风控经理、风险管理部总经理助理、风险管理部总经理兼风控总监。

张奇先生，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司信息技术部总经理。历任沈阳联正科技有限公司技术部经理，北京致达赛都科技有限公司

网络部经理，上海致达信息产业股份有限公司技术支持部经理，中海基金管理有限公司信息技术部工程师、信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理。

3、高级管理人员

黄鹏先生，总经理。复旦大学金融学专业硕士。历任上海市新长宁（集团）有限公司销售经理，上海浦东发展银行股份有限公司大连分行行长秘书，中海信托股份有限公司综合管理部经理助理、投资管理部经理、风控委员会委员。2007年10月进入本公司工作，曾任董事会秘书、总经理助理兼营销中心总经理，2011年10月至今任本公司总经理，2013年2月至今任本公司董事，2013年7月至今任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。

宋宇先生，常务副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，历任本公司督察长、副总经理（期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理，2014年5月至2014年10月兼任本公司代理督察长），2015年4月至今任本公司常务副总经理。

王莉女士，督察长。华东政法学院国际经济法专业学士。历任中银国际证券有限责任公司研究部翻译，上海源泰律师事务所律师助理。2006年9月进入本公司工作，历任监察稽核部监察稽核经理、监察稽核部部门负责人、督察长兼监察稽核部总经理兼信息披露负责人。2015年5月至今任本公司督察长兼信息披露负责人。

4、基金经理

江小震先生，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、固定收益部总经理，现任投资副总监。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, 2016年4月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理, 2016年4月至今任中海纯债债券型证券投资基金基金经理, 2016年4月至今任中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金经理, 2016年4月至今任中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理, 2016年7月至今任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理, 2016年8月至今任中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理。

5、历任基金经理

本基金基金合同于2013年1月7日生效, 历任基金经理如下表:

基金经理姓名	管理本基金时间
江小震	2013年1月7日-2013年1月11日
江小震、陆成来	2013年1月12日-2015年5月25日
江小震	2015年5月26日至今

6、投资决策委员会成员

黄鹏先生, 主任委员。现任中海基金管理有限公司董事、总经理。

许定晴女士, 委员。现任中海基金管理有限公司代理投资总监、投资副总监、基金经理。

夏春晖先生, 委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、首席策略分析师、基金经理。

江小震先生, 委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

蒋佳良先生, 委员。现任中海基金管理有限公司研究部总经理、基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、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

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）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：黄鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或 021-38789788

公司网址：www.zhfund.com

（2）中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218
负责人：李想
电话：010-66493583
传真：010-66425292
联系人：邹意
客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）
公司网站：www.zhfund.com

2、场外代销机构

（1）招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号
办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号
法定代表人：李建红
传真：0755-83195049
资产托管部信息披露负责人：张燕
客户服务电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人：易会满
联系人：郭明
客户服务电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：周慕冰

传真：(010) 85109219

联系人：林葛

客户服务电话：95599

公司网址：www.abcchina.com

(4) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：何奕

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(5) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系电话：021-38637673

传真电话：021-50979507

联系人：潘琦

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61616193

传真：021-63604196

联系人：高天、杨文川

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（7）上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

联系人：施传荣

电话：（021）38576666

传真：（021）50105124

客户服务电话：（021）962999

公司网站：www.srcb.com

（8）宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：王海燕

电话：0574-89103171

传真：0574-89103213

客户服务电话：95574

网址：http://www.nbcb.com.cn/

（9）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

公司网址: www.glsc.com.cn

(10) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈有安

电话: 010-66568430

传真: 010-66568990

联系人: 田薇

客户服务电话: 4008-888-888

公司网址: www.chinastock.com.cn

(11) 长江证券股份有限公司

住所: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 胡运钊

电话: 027-65799999

传真: 027-85481900

联系人: 李良

客户服务电话: 95579 或 4008-888-999

公司网址: www.95579.com

(12) 海通证券股份有限公司

住所: 上海市广东路 689 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客户服务电话: 95553

公司网址: www.htsec.com

(13) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐、许梦园

电话：400-8888-108

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网址：www.csc108.com

(14) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(15) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(16) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-888-8666/95521

公司网址：www.gtja.com

（17）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（18）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客户服务电话：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

（19）中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：许刚

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：李丹

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

（20）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

公司网址：stock.pingan.com

（21）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（22）中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号 23 层经纪业务总部

法定代表人：李玮

电话：0531-68889115

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（23）第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

电话：0755-23838751

传真：0755-82485081

客户服务电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

（24）万联证券有限责任公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36、37 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

法定代表人：张建军

电话：020-37865070

联系人：王鑫

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

公司网址：www.wlzq.com.cn

（25）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（26）渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

（27）国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号 6、16、17 楼

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

（28）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（29）中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：400-889-5548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（30）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号证券大厦 1005 室

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：4006000686

公司网址：www.nesc.cn

（31）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 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（32）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net.cn

（33）华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

电话：021-68778010

传真：021-68778117

客服电话：400-820-9898、021-38929908

网址：www.cnhbstock.com

（34）长城国瑞证券有限公司

住所：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：王勇

联系人：赵钦

客户服务电话：0592-5163588

公司网站：www.xmzq.cn

（35）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

（36）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（37）华林证券有限责任公司

住所：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5-6 楼

法定代表人：薛荣年

联系人：王叶平

联系电话：0755-82707705

客服电话：400-188-3888

公司网址：http://www.chinalions.com

（38）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

业务联系电话：021-64339000-807

客服热线：021-32109999；029-68918888；4001099918

公司网址：www.cfsc.com.cn

（39）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（40）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

电话：028-86135991

传真：028-86150040

客户服务电话：95584 和 4008-888-818

公司网址：<http://www.hx168.com.cn>

（41）中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

联系电话：01065051166

客服电话：4009101166

公司网址：www.cicc.com.cn

（42）联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心
三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心
三、四楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0752-2119700

传真：0752-2119660

客户服务电话：95564

网址：www.lxsec.com

（43）北京晟视天下投资管理有限公司

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

（44）上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

（45）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

（46）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/>

（47）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

（48）深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

（49）上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

业务联系人：郑茵华

联系电话：021-20691831

客服电话：400-089-1289

公司网址：www.erichfund.com

（50）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 层

法定代表人：汪静波

联系人：徐诚

联系电话：021-38509639

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（51）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

联系电话：021-20835787

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

（52）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：朱玉

联系电话：021-54509977

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（53）众升财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

公司网址：www.wy-fund.com

（54）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（55）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼

法定代表人：李兴春

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533

传真：021-50583535

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

（56）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：周斌

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

公司网址：www.chtfund.com

（57）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层 727 室

法定代表人：杨懿

联系人：刘宝文

联系电话：010-63130889-8369

客服电话：400-166-1188

公司网址：8.jrj.com.cn

（58）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

（59）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系人：孙成岩

联系电话：0571-88337717

客服电话：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

（60）上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

联系电话：18616024775

客服电话：400-820-2819

公司网址：<https://tty.chinapnr.com>

（61）上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

（62）大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

公司网址：www.dtfunds.com

（63）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：王哲宇

联系电话：021-63333389-611

传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

公司网址：www.vstonewealth.com

（64）珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

（65）上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

（66）奕丰金融服务（深圳）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（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

联系电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（67）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

公司网址: www.qianjing.com

(68) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人: 闫振杰

电话: 010-59601366

传真: 010-62020355

联系人: 翟文

客户服务电话: 4008188000

公司网址: www.myfund.com

(69) 深圳市金斧子基金销售有限公司

住所: 深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人: 赖任军

电话: 0755-66892301

传真: 0755-66892399

联系人: 张烨

客户服务电话: 4009500888

公司网址: www.jfzinv.com

(70) 北京广源达信基金销售有限公司

住所: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人: 齐剑辉

电话: 4006236060

传真: 010-82055860

联系人: 王英俊

客户服务电话: 400-623-6060

公司网址: www.niuniufund.com

(71) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077-220

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

网址：www.jiyufund.com.cn

(72) 北京懒猫金融信息服务有限公司

住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人：许现良

电话：010-57649619

传真：010-57649620

联系人：朱翔宇

客户服务电话：010-57649619

公司网址：www.lanmao.com

(73) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312877

联系人：徐越

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(74) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：吴季林

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com>

(75) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

法定代表人：王伟刚

电话：010-62680827

传真：010-62680827

联系人：丁向坤

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.fundzone.cn

(76) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

电话：0592-3122672

传真：0592-3122701

联系人：梁云波

客户服务电话：400-9180808

公司网址：www.xds.com.cn

(77) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块
新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

电话：010-62676405

传真：8610-62675979

联系人：付文红

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

（78）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14
层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

电话：010-58160168

传真：010-58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

（79）上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

电话：021-20538888

传真：021-20538999

联系人：江辉

客户服务电话：400-820-1515

公司网址: www.zhengtongfunds.com

(80) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所: 杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址: 杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人: 陈刚

联系人: 胡璇

联系电话: 0571-85267500

传真: 0571-85269200

客服电话: 0571-86655920

公司网址: www.cd121.com

(81) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座

法定代表人: 江卉

联系人: 赵德赛

电话: 4000988511/ 4000888816

传真: 010-89188000

客服电话: 95118

网址: <http://fund.jd.com/>

3、场内代销机构

分级运作期内惠裕 B 基金份额及转换后中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金份额办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员 (具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)。尚未取得相应业务资格, 但属于深圳证券交易所会员的其他机构, 可在惠裕 B 基金份额及中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金份额上市后, 代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与惠裕 B 基金份额及中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金份额的上市交易。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加其他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：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-59378856

传真：010-59378907

联系人：崔巍

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

法定代表人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：赵钰

经办会计师：薛竞、赵钰

四、基金的名称

基金合同生效之日起 3 年内，本基金名称为“中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金”；基金合同生效后 3 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金名称为“中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）”。

五、基金的类型

债券型

六、基金份额的分级

（一）基金份额的分级

本基金在基金合同生效之日起 3 年内的基金份额分为惠裕 A、惠裕 B 两类，所募集的基金资产合并运作。

1、基金份额配比

本基金募集设立时，惠裕 A、惠裕 B 的份额配比将不超过 7:3。本基金基金合同生效之日起 3 年内的每一个开放日，经注册登记机构确认后的惠裕 A、惠裕 B 的份额配比原则上不超过 7:3。

本基金基金合同生效之日起 3 年内，惠裕 A 自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次，惠裕 B 封闭运作并上市交易。在惠裕 A 的每次开放日，基金管理人将对惠裕 A 进行基金份额折算（但《基金合同》生效之日起 3 年内第六个惠裕 A 的开放日惠裕 A 不折算），惠裕 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的惠裕 A 份额数按折算比例相应增减。在惠裕 A 的单个开放日，如果惠裕 A 没有赎回或者净赎回份额极小，惠裕 A、惠裕 B 在该次开放日后的份额配比可能会出现大于 7:3 的情形；如果惠裕 A 的净赎回份额较多，惠裕 A、惠裕 B 在该次开放日后的份额配比可能会出现小于 7:3

的情形。

2、惠裕 A 的运作

（1）收益率

惠裕 A 根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个开放日设定一次并公告。计算公式为：

惠裕 A 的年收益率（单利）=1 年期银行定期存款基准利率+1.4%

惠裕 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第 2 位。

在基金合同生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率设定惠裕 A 的首次年收益率，该收益率即为惠裕 A 基金合同生效后最初 6 个月的年收益率，适用于基金合同生效日（含）到第 1 个开放日（含）的时间段；在惠裕 A 的每个开放日（最后 1 个开放日除外），基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定惠裕 A 的年收益率，该收益率即为惠裕 A 接下来 6 个月的年收益率，适用于该开放日（不含）到下个开放日（含）的时间段；在惠裕 A 的最后 1 个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定惠裕 A 的年收益率，该收益率适用于该开放日（不含）到基金合同生效后 3 年期届满日（含）的时间段。

例：在本基金基金合同生效日，如果 1 年期银行定期存款利率为 3.00%，则惠裕 A 的年收益率（单利）为：惠裕 A 的年收益率（单利）=3.00%+1.4%=4.40%

（2）开放日

惠裕 A 在基金合同生效后 3 年内每满 6 个月（该 6 个月，下称为“惠裕 A 开放周期”）开放一次，接受投资人的申购与赎回。

惠裕 A 的开放日为自基金合同生效之日起 3 年内每满 6 个月的最后一个

工作日。惠裕 A 的第 n ($1 \leq n \leq 6$) 个开放日为基金合同生效满 $n \times 6$ 个月的最后一个工作日。

因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的,开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

惠裕 A 的第一次开放日为基金合同生效日至满 6 个月的日期,如该日为非工作日,则为该日之前的最后一个工作日;第二次开放日为基金合同生效之日起至 12 个月满的日期,如该日为非工作日,则为该日之前的最后一个工作日;以此类推。如基金合同的生效日为 2012 年 10 月 7 日,基金合同生效之日起满 6 个月、满 12 个月、满 18 个月的日期分别为 2013 年 4 月 6 日、2013 年 10 月 6 日、2014 年 4 月 6 日,以此类推。假设 2013 年 4 月 6 日为非工作日,在其之前的最后一个工作日为 2013 年 4 月 5 日,则第一次开放日为 2013 年 4 月 5 日。其他各个开放日的计算类同。

(3) 基金份额折算

本基金基金合同生效之日起 3 年内每满 6 个月的最后一个工作日,基金管理人将对惠裕 A 进行基金份额折算(但《基金合同》生效之日起 3 年内第六个惠裕 A 的开放日惠裕 A 不折算),惠裕 A 的基金份额净值调整为 1.000 元,基金份额持有人持有的惠裕 A 份额数按折算比例相应增减。惠裕 A 的基金份额折算基准日与开放日为同个工作日(但《基金合同》生效之日起 3 年内第六个惠裕 A 的开放日惠裕 A 不折算)。

惠裕 A 的基金份额折算具体见招募说明书第九部分以及基金管理人届时发布的相关公告。

(4) 规模限制

基金合同生效之日起 3 年内的每个开放日,经注册登记机构确认后的惠裕 A 的份额余额较惠裕 B 的份额余额原则上不得超过 $7/3$ 。具体规模限制及其控制措施见基金份额发售公告以及基金管理人发布的其他相关公告。

3、惠裕 B 的运作

(1) 惠裕 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。

惠裕 B 的封闭期为自基金合同生效之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

(2) 本基金基金合同生效后 3 个月内，在符合基金上市交易条件下，惠裕 B 将申请在深圳证券交易所上市交易。

(3) 本基金在扣除惠裕 A 的应计收益后的全部剩余收益归惠裕 B 享有，亏损以惠裕 B 的资产净值为限由惠裕 B 承担。基金管理人并不承诺或保证惠裕 A 的约定应得收益，即如在本基金资产出现极端损失情况下，惠裕 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险，此时惠裕 B 剩余资产可能为 0。

(二) 基金份额净值的计算

1、本基金基金份额净值的计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日闭市后的基金资产净值} / T \text{ 日基金份额的余额数量}$$

基金合同生效之日起 3 年内，T 日基金份额的余额数量为惠裕 A 和惠裕 B 的份额总额；基金合同生效后 3 年期届满并转为上市开放式基金（LOF）后，T 日基金份额的余额数量为该 LOF 基金的份额总额。

本基金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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额净值计算

基金合同生效后，在惠裕 A 的开放日计算惠裕 A 的基金份额净值；在惠裕 B 的封闭期届满日分别计算惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额净值。

(1) 惠裕 A 的基金份额净值计算

基金合同生效后,截止惠裕 A 的某一开放日或者惠裕 B 的封闭期届满日 (T 日), 设 T_a 为自惠裕 A 上一次开放日 (如 T 日为第一次开放日, 则为基金成立日) 至 T 日的运作天数, NV_T 为 T 日闭市后的基金资产净值, F_{aT} 为 T 日惠裕 A 的份额余额, F_b 为 T 日惠裕 B 的份额余额, NAV_{aT} 为 T 日惠裕 A 的基金份额净值, $NAV_{a(T0)}$ 为惠裕 A 上一开放日折算后的份额净值 1.000, 若上一开放日未发生折算, 则为上一开放日惠裕 A 的份额净值, r 为在惠裕 A 上一次开放日 (如 T 日为第一次开放日, 则为基金成立日) 设定的惠裕 A 的年收益率。

1) 如果 T 日闭市后的基金资产净值大于或等于 “ $NAV_{a(T0)} \times T$ 日惠裕 A 的份额余额加上 T 日全部惠裕 A 份额应计收益之和”, 则:

$$NAV_{aT} = NAV_{a(T0)} \times \left(1 + \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a \right)$$

“T 日全部惠裕 A 份额应计收益” 计算公式如下:

$$T \text{ 日全部惠裕 A 份额应计收益} = F_{aT} \times NAV_{a(T0)} \times \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a$$

(下同)

以上各式中, 运作当年实际天数指惠裕 A 上一次开放日 (如 T 日为第一次开放日, 则为基金成立日) 所在年度的实际天数, 下同。

2) 如果 T 日闭市后的基金资产净值小于 “ $NAV_{a(T0)} \times T$ 日惠裕 A 的份额余额加上 T 日全部惠裕 A 份额应计收益之和”, 则:

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

(2) 惠裕 B 的基金份额净值计算

设 NAV_{bT} 为惠裕 B 封闭期届满日 (T 日) 惠裕 B 的基金份额净值, 惠裕

B 的基金份额净值计算公式如下：

$$NAV_{bT} = \frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_b}$$

惠裕 A、惠裕 B 的基金份额净值的计算，保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：本基金《基金合同》生效后 3 年期届满日，设自惠裕 A 上一次开放日和折算日起的运作天数为 120 天，基金运作当年的实际天数为 365 天，基金资产净值为 21 亿元，惠裕 A、惠裕 B 的份额余额分别为 14 亿份和 6 亿份，惠裕 A 上一次开放日设定的惠裕 A 年收益率为 4.65%。则惠裕 A、惠裕 B 的基金份额净值计算如下：

$$\text{惠裕 A 的基金份额净值} = 1.00 \times \left(1 + \frac{4.65\%}{365} \times 120 \right) = 1.01528767 \text{ (元)}$$

$$\text{惠裕 B 的基金份额净值} = \frac{21 - 14 \times 1.01528767}{6} = 1.13099544 \text{ (元)}$$

3、惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额参考净值计算

基金合同生效之日起 3 年内，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额参考净值，其中，惠裕 A 的基金份额参考净值计算日不包括惠裕 A 的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

(1) 惠裕 A 的基金份额参考净值计算

基金合同生效之日起 3 年内，在惠裕 A 的非开放日（T 日），设 T_a 为自惠裕 A 上一次开放日（如 T 日之前惠裕 A 尚未进行开放，则为基金成立日）至 T 日的运作天数， NV_T 为 T 日闭市后的基金资产净值， F_{aT} 为 T 日惠裕 A 的份额余额， F_b 为 T 日惠裕 B 的份额余额， NAV_{aT} 为 T 日惠裕 A 的基金份额参考净值， $NAV_{a(T0)}$ 为惠裕 A 上一开放日折算后的份额净值

1.000, 若上一开放日未发生折算, 则为上一开放日惠裕 A 的份额净值, r 为在惠裕 A 上一次开放日(如 T 日之前惠裕 A 尚未进行开放, 则为基金成立日)设定的惠裕 A 的年收益率。

1) 如果 T 日闭市后的基金资产净值大于或等于 “ $NAV_{a(T0)} \times T$ 日惠裕 A 的份额余额加上 T 日全部惠裕 A 份额应计收益之和”, 则:

$$NAV_{aT} = NAV_{a(T0)} \times \left(1 + \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a \right)$$

“T 日全部惠裕 A 份额应计收益” 计算公式如下:

$$T \text{ 日全部惠裕 A 份额应计收益} = F_{aT} \times NAV_{a(T0)} \times \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a$$

(下同)

以上各式中, 运作当年实际天数指惠裕 A 上一次开放日(如 T 日之前惠裕 A 尚未进行开放, 则为基金成立日)所在年度的实际天数, 下同。

2) 如果 T 日闭市后的基金资产净值小于 “ $NAV_{a(T0)} \times T$ 日惠裕 A 的份额余额加上 T 日全部惠裕 A 份额应计收益之和”, 则:

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

(2) 惠裕 B 的基金份额参考净值计算

NAV_{bT} 为 T 日惠裕 B 的基金份额参考净值, 惠裕 B 的基金份额参考净值计算公式如下:

$$NAV_{bT} = \max \left(\frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_b}, 0 \right)$$

上式中, 在本基金《基金合同》生效之日起 3 年内的惠裕 A 非开放日, NAV_{aT} 为惠裕 A 的基金份额参考净值; 在惠裕 A 的开放日, NAV_{aT} 为惠裕 A 的基金份额净值。

惠裕 A、惠裕 B 的基金份额参考净值的计算, 保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入, 由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

T 日的惠裕 A 和惠裕 B 的基金份额参考净值在当天收市后计算,并在 T+1 日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

例:本基金《基金合同》生效之日起 3 年内,设自惠裕 A 上一次开放日和折算日起的运作天数为 90 天,基金运作当年的实际天数为 365 天,基金资产净值为 21 亿元,惠裕 A、惠裕 B 的份额余额分别为 14 亿份和 6 亿份,惠裕 A 上一次开放日设定的惠裕 A 年收益率为 4.65%。则惠裕 A、惠裕 B 的基金份额参考净值计算如下:

$$\text{惠裕 A 的基金份额参考净值} = 1.00 \times \left(1 + \frac{4.65\%}{365} \times 90 \right) = 1.011 \text{ (元)}$$

$$\text{惠裕 B 的基金份额参考净值} = \frac{21 - 14 \times 1.011}{6} = 1.141 \text{ (元)}$$

(三) 基金合同生效后 3 年期届满时的基金份额转换

基金合同生效后 3 年期届满,本基金将按照基金合同约定转换为上市开放式基金(LOF),惠裕 A、惠裕 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购、赎回业务。

基金合同生效后 3 年期届满时的基金转换见本基金招募说明书第十二部分及基金管理人已发布的相关公告。

七、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

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。

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%。

九、基金的投资策略

1、固定收益品种的配置策略

（1）久期配置

本基金基于对宏观经济指标（包括国内生产总值、工业增加值、固定资产投资、消费品市场、价格指数和货币信贷等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策和产业政策等）的分析，判断宏观经济所处的经济周期，由此预测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；同时结合债券市场资金供求分析，最终确定投资组合的久期配置。

（2）期限结构配置

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用统计和数量分析技术，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，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。

子弹组合，即，使组合的现金流尽量集中分布；

杠铃组合，即，使组合的现金流尽量呈两极分布；

梯形组合，即，使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

（3）债券类别配置/个券选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。

在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上，本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾其基本面分析，综合分析各品种的利差和变化趋势。在信用利差水平较高时持有金融债、公司债（企业债）、资产支持证券等信用品种，在信用利差水平较低时持有国债、央行票据等利率品种，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

个券选择应遵循如下原则：

相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低品种。

流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。

2、信用品种的投资策略（中小企业私募债除外）

本基金对金融债、企业债、公司债和资产支持证券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用品种的信用风险、流动性风险、市场风险等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本基金运用行业和公司基本面研究方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

本基金将借助公司内部行业及公司研究员的专业研究能力，并综合参考外部研究机构的研究成果，对发债主体企业进行深入的基本面分析，主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、公司治理、股东或地方政府的实力以及支持力度等；并结合债券的发行条款，综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上以确定信用品种的实际信用风险状况及其信用利差水平，投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。

3、中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略，在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

4、其它交易策略

（1）杠杆放大策略：即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入

低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

(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。本基金将利用两个市场相同公司债券交易价格的差异，锁定其中的收益进行跨市场套利，增加基金资产收益。

十、基金的投资限制

1、组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

(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 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。

十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

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比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告，而无需基金份额持有人大会审议。

十二、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金《基金合同》生效之日起 3 年内，本基金经过基金份额分级后，惠裕 A 为低风险、收益相对稳定的基金份额；惠裕 B 为较高风险、较高收益的基金份额。

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。

基金托管人招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 2017 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

截至 2017 年 6 月 30 日，中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF)

资产净值为 530,519,979.27 元，基金份额净值为 1.039 元，累计基金份额净值为 1.329 元。其资产组合情况如下：

金额单位：人民币元

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	507,008,071.10	89.10
	其中：债券	507,008,071.10	89.10
	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	49,560,284.58	8.71
	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	1,708,174.62	0.30
8	其他资产	10,770,959.12	1.89
9	合计	569,047,489.42	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

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

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,871,000.00	5.63
	其中：政策性金融债	29,871,000.00	5.63
4	企业债券	406,341,071.10	76.59
5	企业短期融资券	10,055,000.00	1.90
6	中期票据	60,741,000.00	11.45

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	507,008,071.10	95.57

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

金额单位：人民币元

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	1680094	16 启国投债	400,000	38,536,000.00	7.26
2	124131	PR 安国资	600,000	37,080,000.00	6.99
3	124240	PR 合工投	600,970	36,977,684.10	6.97
4	124209	PR 三门峡	600,000	36,588,000.00	6.90
5	124159	PR 绍城改	500,000	30,650,000.00	5.78

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股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、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

本基金本报告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。

11、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) 本基金为纯债基金，不进行股票投资。

(3) 截至 2017 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,855.81
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	10,769,103.31
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,770,959.12

(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债。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

(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

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。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截至 2017 年 6 月 30 日）：

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
2013.01.07- 2013.12.31	-0.55%	0.13%	-1.04%	0.10%	0.49%	0.03%
2014.01.01- 2014.12.31	15.24%	0.26%	10.82%	0.09%	4.42%	0.17%
2015.01.01- 2015.12.31	12.68%	0.12%	8.74%	0.08%	3.94%	0.04%
2016.01.01- 2016.01.07	0.82%	0.41%	0.04%	0.10%	0.77%	0.30%
2016.01.08- 2016.12.31	2.30%	0.08%	2.01%	0.09%	0.29%	-0.01%
2017.01.01- 2017.06.30	1.56%	0.07%	-0.20%	0.07%	1.76%	0.00%
自基金合同 生效起至今	3.90%	0.08%	1.80%	0.09%	2.10%	-0.01%

注：本基金合同生效日为 2013 年 1 月 7 日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。本基金于 2016 年 1 月 8 日三年到期转型为 LOF 类型基金。

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、律师费和诉讼费；
- 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

在基金合同生效之日起3年内或基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人的管理费均按基金资产净值的0.7%年费率计提。

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

在基金合同生效之日起3年内或基金合同生效后3年期届满转为上市开放式基金（LOF）后，基金托管人的托管费均按基金资产净值的0.2%年费率计提

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。

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

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。

十六、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“基金管理人”部分进行了更新。

（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“基金的投资”部分，对“基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。

（五）对“基金的业绩”按最新资料进行了更新。

（六）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

二〇一七年八月十九日