

海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

基金份额发售公告

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中信证券股份有限公司
登记机构：中国证券登记结算有限公司
基金销售机构：投资者可通过销售机构认购本基金

销售机构为海富通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的直销机构和其他销售机构（即符合《证券投资基金销售管理办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商）。

发售主协调人：海通证券股份有限公司

网下现金发售和网下债券发售直销机构：海富通基金管理有限公司

网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构：海通证券股份有限公司

网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

基金管理人可根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》和《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资 基金基金份额发售公告

重要提示

1. 海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证券监督管理委员会证监许可〔2019〕2352号文注册。中国证监会对本基金募集的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或保证。

2. 本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

3. 本基金管理人为海富通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）；基金托管人为中信证券股份有限公司；登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4. 本基金自2020年5月8日起至2020年8月7日止，通过销售机构公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购以及网下债券认购三种方式认购本基金。其中，网上现金认购的发售日期为2020年8月5日至2020年8月7日，网下现金认购和网下债券认购的发售日期为2020年5月8日至2020年8月7日。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金管理人可办理网下现金发售和网下债券发售。

本基金的网下现金发售和网下债券发售的发售代理机构为：海通证券股份有限公司。

5. 投资者认购本基金时需持有上海证券交易所A股账户（以下简称“A股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“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份额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份额的申购、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。

6. 本基金认购费用或认购佣金不超过认购份额的 0.4%。

7. 网上现金认购单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 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。通过发售代理机构办理网下债券认购的，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；投资者通过基金管理人办理网下债券认购的，单笔认购份额须在 50 万份以上（含 50 万份）。上述认购方式投资者均可以多次认购，累计认购不设上限。

8. 网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购、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。

9. 销售网点（指基金管理人和/或销售机构的销售网点）对申请的受理并不

表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请。申请的成功确认应以登记机构或基金管理人的确认登记为准。基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

10. 本公告仅对本基金基金份额发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读 2020 年 4 月 28 日刊登在本公司网站（www.hftfund.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

11. 各发售代理机构的销售网点以及开户认购等事项的详细情况请向各发售代理机构咨询。

12. 对于未开设销售网点地区的投资人，请拨打本公司的全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）咨询基金认购事宜。

13. 基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整，并予以公告。

14. 基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商（亦称“一级交易商”）名单，报上海证券交易所，经有关部门认可后，由上海证券交易所公告。本基金上市后，指定交易未在一级交易商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖，如投资人需进行本基金的申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到本基金的一级交易商。

15. 风险提示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资

者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证投资级可转债及可交换债券指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金以 1 元初始面值开展基金募集，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

投资者应当通过基金管理人或基金发售代理机构认购本基金，基金发售代理机构名单详见本基金招募说明书以及相关公告。

一、本次发售基本情况

1. 基金名称

海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金（基金场外简称：海富通上证投资级可转债 ETF，场内简称：上证转债，网上现金认购代码：511183，二级市场交易代码：511180）。

2. 基金的类别

债券型证券投资基金

3. 基金的运作方式

交易型开放式

4. 基金存续期限

不定期

5. 投资目标

本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%，年化跟踪误差不超过3%。

6. 基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

7. 投资范围和对象

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、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、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、同业存单、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）。

本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票，但可持有因可转债转股或可交换债券换股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。

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90%，且不低于非现金基金资产的80%。

8. 发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

9. 销售机构

（1）发售协调人

主协调人：海通证券股份有限公司

（2）网下现金发售和网下债券发售直销机构

海富通基金管理有限公司

(3) 网下现金发售和网下债券发售代理机构
海通证券股份有限公司。

(4) 网上现金发售代理机构

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询。

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。

10. 发售时间安排与基金合同生效

根据有关法律法规的规定,基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过3个月。本基金募集期自2020年5月8日起至2020年8月7日,期间面向个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者同时发售。其中,网下现金认购和网下债券认购的发售期间为2020年5月8日起2020年8月7日,网上现金认购的发售日期为2020年8月5日起至2020年8月7日。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。募集结束,若符合基金合同规定的生效条件,基金管理人将办理基金备案手续,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。

投资人多次认购的,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例配售方式对有效认购金额进行部分确认时,须按照认购申请的确认金额确定认购费率,并据此计算认购费用,且认购申请确认金额不受认购最低金额的限制。

若3个月的法定募集期满,本基金的基金合同仍未达到基金合同规定的生效条件,本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,并将所募集的资金加计募集期间投资者通过现金认购方式购买本基金所产生的同期活期存款利息在募集期结束后30天内退还给基金认购人。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,发售代理机构将协助基金管理人、登记机构完成相关资金和证券的退还工作。

11. 基金认购方式与费率

(1) 认购费

认购费用由投资人承担，不高于 0.4%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
50 万份以下	0.40%
50 万份以上（含），100 万份以下	0.20%
100 万份以上（含）	每笔 1000 元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

（2）网上现金认购

1) 认购时间：2020 年 8 月 5 日起至 2020 年 8 月 7 日上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。

2) 认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3) 认购金额的计算

本基金认购金额的计算如下：

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）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

（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）

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者到某发售代理机构网点认购 10,000 份本基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.4%，则需准备的资金金额计算如下：

认购佣金=10,000×1.00×0.4%=40 元

认购金额=10,000×1.00×（1+0.4%）=10,040 元

即投资者需准备 10,040 元资金，方可认购到 10,000 份本基金基金份额

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：2020 年 5 月 8 日起至 2020 年 8 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2020年5月8日起至2020年8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手部分须为1手的整数倍。投资者通过基金管理人办理网下债券认购的，单笔认购份额须在50万份以上（含50万份）。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

(1) 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。

(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。

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：

$$\text{投资者的认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只债券的价值} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

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 日的第三方估值机构估值价(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

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

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的直销机构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

投资者认购本基金时需持有证券账户，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者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：2020年8月5日起至 2020年8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）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：2020年5月8日起至2020年8月7日，具体业务办理时间由基金管理人确定。

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（包括居民身份证及其他有效身份证件）原件及复印件；

②机构投资者提供企业营业执照副本原件或加盖单位公章的复印件；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或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；加盖公章的《风险承受能力问卷调查表》；加盖公章及法定代表人私章的《投资风险提示书》及《承诺函》；

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	开户行	账号	大额支付系统行号
海富通基金管理有限公司	工商银行上海市分行营业部	1001202919025810112	102290024433

5) 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“认购上证转债 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: 2020年5月8日起至2020年8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。

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: 2020年5月8日起至2020年8月7日, 具体业务办理时间由基金管理人确定。

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（包括居民身份证及其他有效身份证件）原件及复印件；

②机构投资者提供企业营业执照副本原件或加盖单位公章的复印件；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或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；加盖公章的《风险承受能力问卷调查表》；加盖公章及法定代表人私章的《投资风险提示书》及《承诺函》；

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投资级可转债及可交换债券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。账户证明是指银行借记卡等。

（2）发售代理机构

1) 业务办理时间：2020年5月8日起至2020年8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投资级可转债及可交换债券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投资级可转债及可交换债券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, 不折算为投资人基金份额。投资人以债券认购的, 认购债券由登记机构予以冻结, 冻结期间产生的孳息归投资人所有。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退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，发售代理机构将协助基金管理人、登记机构完成相关资金和证券的退还工作

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

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：杨仓兵

电话：021-38650999

传真：021-50479997

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：中信证券股份有限公司

法定代表人：张佑君

住所：广东省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

联系电话：010-60838888

联系人：吴俊文

成立时间：1995 年 10 月 25 日

批准设立机关和批准设立文号：国家工商总局，100000000018305

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币壹佰贰拾壹亿壹仟陆佰玖拾万捌仟肆佰元整

(三) 销售机构

(1) 发售协调人

a. 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：周杰

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

(2) 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：杨仓兵

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

(3) 网下现金发售和网下债券发售代理机构

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：周杰

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

(4) 网上现金发售代销机构

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询。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：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（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）

注册地址：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

法人代表：李丹

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

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投资级可转债及可交换债券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
------	------	------	------	------	------

110031	航信转债	113011	光大转债	113531	百姓转债
110033	国贸转债	113012	骆驼转债	113532	海环转债
110034	九州转债	113013	国君转债	113534	鼎胜转债
110038	济川转债	113014	林洋转债	113542	好客转债
110041	蒙电转债	113016	小康转债	113543	欧派转债
110042	航电转债	113017	吉视转债	113544	桃李转债
110043	无锡转债	113019	玲珑转债	113545	金能转债
110045	海澜转债	113020	桐昆转债	113547	索发转债
110047	山鹰转债	113021	中信转债	113549	白电转债
110048	福能转债	113022	浙商转债	113551	福特转债
110051	中天转债	113024	核建转债	113554	仙鹤转债
110052	贵广转债	113025	明泰转债	113558	日月转债
110053	苏银转债	113026	核能转债	113562	璞泰转债
110055	伊力转债	113027	华钰转债	113563	柳药转债
110056	亨通转债	113028	环境转债	132004	15 国盛 EB
110057	现代转债	113029	明阳转债	132005	15 国资 EB
110058	永鼎转债	113030	东风转债	132006	16 皖新 EB
110059	浦发转债	113031	博威转债	132007	16 凤凰 EB
110060	天路转债	113032	桐 20 转债	132008	17 山高 EB
110061	川投转债	113504	艾华转债	132009	17 中油 EB
110062	烽火转债	113505	杭电转债	132011	17 浙报 EB
110063	鹰 19 转债	113508	新风转债	132012	17 巨化 EB
110064	建工转债	113515	高能转债	132013	17 宝武 EB
110065	淮矿转债	113516	吴银转债	132014	18 中化 EB
110066	盛屯转债	113518	顾家转债	132015	18 中油 EB
110067	华安转债	113519	长久转债	132017	19 新钢 EB
110068	龙净转债	113525	台华转债	132018	G 三峡 EB1
113008	电气转债	113527	维格转债	132020	19 蓝星 EB
113009	广汽转债	113530	大丰转债	132021	19 中电 EB

海富通基金管理有限公司

2020年4月28日