东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金份额发售公告

【本基金暂不向个人投资者公开销售】

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

重要提示

一、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2024年3月29日中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于准予东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2024]505号）准予募集注册。中国证监会对本基金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。

二、本基金的基金类型为债券型基金，本基金的运作方式为契约型、开放式。

三、本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称"本公司"），基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称："上海浦东发展银行"），登记机构为本公司。

四、本基金销售机构包括直销机构和其他销售机构。

五、本基金自2024年5月9日至2024年8月8日通过基金销售机构公开发售，本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。本公司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。

六、募集规模上限

本基金首次募集规模上限为80亿元人民币（不含募集期利息，下同）。

基金募集过程中，募集规模接近、达到或超过80亿元时，基金可提前结束募集。

在募集期内任何一日（含首日），若当日募集截止时间后基金份额累计有效认购申请金额（不包括利息，下同）合计超过80亿元，基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者，由此产生的损失由投资者自行承担。

当发生部分确认时，当日投资者认购的认购费率按照认购申请确认金额所对应的费率计算，当日投资者认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。

七、本基金募集对象为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。个人投资者指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人；机构投资者指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；合格境外投资者指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

本基金暂不向个人投资者公开发售，如未来本基金开放向个人投资者公开发售或对发售对象的范围予以进一步限定，基金管理人将另行公告。

八、本基金募集份额总额不少于2亿份，募集金额不少于2亿元。

九、投资者欲购买本基金，需开立本公司基金账户。除法律法规另有规定外，每个投资者仅允许开立一个本公司基金账户，已经开立本公司基金账户的投资者无须重复开户。本基金直销机构和其他销售机构同时为投资者办理开立基金账户和认购的手续，但认购申请的确认须以开户确认成功为前提条件。如同日在不同销售机构申请开立基金账户，可能导致开户失败。

十、认购以金额申请。投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。投资者在直销机构首次认购本基金的最低认购金额为1.00元（含认购费（如有），下同），追加认购的单笔最低金额为1.00元，累计认购金额不设上限（但需满足本基金关于募集上限和法律法规关于投资者累计持有基金份额上限的相关规定）。本基金在其他销售机构的认购限额，详见各销售机构的相关公告。

十一、投资者有效认购款项在基金募集期间产生的利息归投资者所有，如基金合同生效，则折算为基金份额计入投资者的账户，具体份额以登记机构的记录为准。

十二、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

十三、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的任何损失由投资者自行承担。投资者应在《基金合同》生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

十四、本公告仅对本基金募集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，请详细阅读披露在本公司网站及中国证监会基金电子披露网站上的《东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金招募说明书》、《东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金产品资料概要》、《东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金合同》、《东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金托管协议》。本公告及《东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》将于2024年5月6日同时刊登在《中国证券报》。投资人可通过本公司网站下载基金业务申请表格、了解本基金发售的相关事宜。

十五、本基金通过本公司直销机构和其他销售机构为投资者办理基金认购等业务。各销售机构的业务办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

十六、在募集期间，除本公告所列的基金销售机构外，如本基金增加其他的销售机构，本公司将及时公告。

十七、投资者如有任何问题，可拨打本公司客户服务电话400-628-5888咨询，也可拨打其他销售机构的客服热线咨询认购事宜。

十八、本基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

十九、风险揭示

本基金为债券型基金，理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

本基金属于指数基金，采用抽样复制和动态最优化的策略，跟踪中债绿色普惠主题金融债券优选指数，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。

本基金所面临的风险主要包括以下部分：

（一）系统性风险

系统性风险是指由于经济、政治、环境等因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括利率风险、政策风险、经济周期风险、购买力风险等。

①利率风险：对于债券投资而言，利率的变化不仅会影响债券的价格及投资者对于后市的预期，而且会带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

②政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

③经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况。证券市场对宏观经济运行状况的直接反应将影响本基金的收益水平。

④购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资者实际收益水平下降的风险。

（二）非系统性风险

非系统性风险是指个别行业或个别证券特有的风险，主要为信用风险，具体包括基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券发行人出现违约、无法支付到期本息，或者由于债券发行人信用等级下降等原因造成的基金资产损失的风险。

（三）流动性风险

流动性风险主要包括以下两个方面：一方面是指在市场流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

一）本基金申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作，基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券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、赎回时除外。

除上述申购、赎回安排以外，本基金拟就大额申购及巨额赎回两个方面做好预防基金流动性风险的准备措施。

1. 大额申购

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，本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；

若接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时，本基金管理人有权拒绝或暂停接受超出比例的申购申请。

2. 巨额赎回

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或延期办理赎回申请。

另外，在出现巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额20%的基金份额，基金管理人有权进行延期办理。延期办理的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据招募说明书"基金份额的申购与赎回"部分"巨额赎回的情形及处理方式"中"全额赎回"或"部分延期赎回"的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

二）投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券。为更好实现投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括除标的指数成份券及其备选成份券以外的公开发行的债券（含国债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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。

上述资产均存在规范的交易场所，运作方式规范透明，从市场历史数据来看，具备良好的流动性。本基金针对各类投资标的的流动性特点进行分散投资，根据法律法规及本基金基金合同的约定，及时调整7个工作日内可变现资产的配置情况，确保投资资产处于较高的流动性。当基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值不足支付当日净赎回申请所需资金时，本基金管理人有权按比例拒绝基金份额持有人的赎回申请。

三）巨额赎回下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

1. 延期办理巨额赎回申请；
2. 暂停接受赎回申请；
3. 延缓支付赎回款项；
4. 摆动定价；
5. 暂停基金估值；
6. 实施侧袋机制；
7. 收取短期赎回费；
8. 中国证监会认定的其他措施。

四）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

1. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购/赎回申请。在此情形下，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额或延迟取得赎回款项的风险。

2. 在出现巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额20%的基金份额，基金管理人有权进行延期办理。具体措施请见基金合同及招募说明书中"基金份额的申购与赎回"部分"巨额赎回的情形及处理方式"。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

3. 持有人提出赎回申请时，本基金对持有期少于7日的投资者收取1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

4. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

5. 暂停估值的情形

①基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

②因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

③当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

④法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

6. 侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策， 因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

（四）运作风险

①管理风险：指在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险，或者由于基金管理人内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

②交易风险：指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

③运作风险：由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等突发情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

④道德风险：指业务人员道德行为违规产生的风险，包括由内幕交易、违规操作、欺诈行为等原因造成的风险。

（五）本基金特有的风险

一）本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

1. 信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

2. 利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

3. 流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

4. 提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

5. 操作风险：基金相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、交易错误、IT系统故障等风险。

6. 法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产的损失。

二）本基金在投资中将国债期货纳入到投资范围中，因此，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

三）本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。主要如下：

1. 流动性风险：是信用衍生品在交易转让过程中因无法找到交易对手或交易对手较少导致难以将基金以合理价格变现的风险。

2. 偿付风险：是指在存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳，或创设机构的现金流与预期发生一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。

3. 价格波动风险：是指由于创设机构或所受保护债务主体经营情况或利率环境出现变化，引起信用衍生品交易价格波动的风险。

四）《基金合同》生效后，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。因此投资者可能面临《基金合同》自动终止的风险。

五）指数化投资相关的风险

1. 标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个债券市场。标的指数成份券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

2. 标的指数波动的风险

标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、发行主体经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3. 标的指数计算出错的风险

指数编制方法的缺陷可能导致标的指数的表现与总体市场表现产生差异，从而使基金收益发生变化。同时，中债金融估值中心有限公司不对指数的实时性、完整性和准确性做出任何承诺。标的指数值可能出现错误，投资者若参考指数值进行投资决策可能导致损失。

4. 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份券或变更编制方法、或标的指数成份券在标的指数中的权重发生变化、或成份券流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素，可能导致本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性较好的成份券以及备选成份券，或选择非成份券作为替代，基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，从而可能导致基金实际收益率与标的指数收益率产生偏离。

在标的指数编制中，债券利息计算再投资收益，而基金再投资中未必能获得相同的收益率。

5. 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

6. 成份券停牌或违约的风险

可能面临因成份券发行人不能按时支付债券利息或偿还本金，从而带来损失的风险。

本基金运作过程中，当标的指数成份券发生明显负面事件面临违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

7. 跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，将年化跟踪误差控制在4%以内。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（六）法律风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

（七）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

根据交易所就资金前端额度控制的相关要求，基金管理人（交易参与人）按照前一交易日日终的相关产品的合计资产总额作为每个交易日申报的最高额度，并与基金托管人（结算参与人）明确约定额度申报事项。由于交易所就资金前端额度控制的规定，从而可能存在影响本基金财产收益的风险。

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，遵循基金投资"买者自负"的原则，全面认识产品风险收益特征和产品特征，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场和基金的投资价值，在对认购、申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

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。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人基金投资的"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，由投资人自行负担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本发售公告、本基金《招募说明书》以及相关公告。

二十、本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次基金募集的基本情况

（一）基金名称：东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金

（二）基金简称及代码

基金简称：东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数A，基金代码：021303

基金简称：东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数C，基金代码：021304

（三）基金类别：债券型证券投资基金

（四）基金运作方式：契约型、开放式

（五）基金存续期限：不定期

（六）基金初始份额面值：1.00元人民币

（七）募集方式：本基金通过销售机构向投资者公开发售。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

（八）募集对象：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。本基金暂不向个人投资者公开发售，如未来本基金开放向个人投资者公开发售或对发售对象的范围予以进一步限定，基金管理人将另行公告。

（九）募集目标：

本基金募集份额总额不少于2亿份，募集金额不少于2亿元。

本基金首次募集规模上限为80亿元人民币（不含募集期利息，下同）。

基金募集过程中，募集规模接近、达到或超过80亿元时，基金可提前结束募集。

在募集期内任何一日（含首日），若当日募集截止时间后基金份额累计有效认购申请金额（不包括利息，下同）合计超过80亿元，基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者，由此产生的损失由投资者自行承担。

当发生部分确认时，当日投资者认购的认购费率按照认购申请确认金额所对应的费率计算，当日投资者认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。

（十）直销机构

本基金直销机构亦即直销中心，仅指本公司网下直销柜台。

直销中心地址：海南省海口市龙华区滨海大道77号中环国际广场21层

直销业务电话：0898-68666597

直销业务传真：0898-68666580

客户服务电话：400-628-5888

发售期间，客户可以通过本公司客户服务中心电话进行募集相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。

（十一）投资者可以通过以下其他销售机构认购本基金：东北证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司。

（十二）募集时间安排与基金合同生效

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。

本基金自2024年5月9日至2024年8月8日进行发售。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。

基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

如基金募集失败，基金管理人应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30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。

基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

（十三）基金认购方式与费率

一）认购费用

本基金仅对A类基金份额收取认购费用，本基金C类基金份额不收取认购费用。

1. 本基金A类基金份额的认购费如下：

本基金对通过基金管理人直销柜台认购本基金A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的认购费率。

养老金客户范围包括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，包括：

1）全国社会保障基金；

2）可以投资基金的地方社会保障基金；

3）企业年金单一计划以及集合计划；

4）企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；

5）企业年金养老金产品；

6）个人税收递延型商业养老保险等产品；

7）养老目标基金；

8）职业年金计划。

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，基金管理人拟将其纳入养老金客户范围的，则将按相关规定履行适当程序。

非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

①通过直销柜台认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率随认购金额的增加而递减。具体认购费率如下表所示：

认购金额（M）	认购费率
M ＜ 100万	0.04%
100万 ≤ M ＜ 300万	0.02%
300万 ≤ M ＜ 500万	0.01%
M ≥ 500万	1000元/笔

②其他投资人认购本基金A类基金份额的认购费率随认购金额的增加而递减。具体认购费率如下表所示：

认购金额（M）	认购费率
M ＜ 100万	0.40%
100万 ≤ M ＜ 300万	0.20%
300万 ≤ M ＜ 500万	0.10%
M ≥ 500万	1000元/笔

2. 本基金A类基金份额的认购费由认购A类基金份额的投资人承担，应在认购基金份额时收取，认购费不列入基金资产，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。

3. 投资者重复认购时，需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。

二）认购份额的计算

1. 基金认购采用金额认购的方式。A类基金份额的认购金额包括认购费用和净认购金额。

A类基金份额计算公式为：

当认购费用适用比例费率时：

认购费用＝认购金额/（1＋认购费率）×认购费率；

净认购金额＝认购金额—认购费用；

认购份额＝（净认购金额＋认购利息）/基金份额发售面值。

当认购费用适用固定金额时：

认购费用＝固定金额；

净认购金额＝认购金额—认购费用；

认购份额＝（净认购金额＋认购利息）/基金份额发售面值。

C类基金份额计算公式为：

认购份额＝（认购金额＋认购利息）/基金份额发售面值。

例1：某投资者（非养老金客户）在认购期投资1,000,000元认购本基金A类基金份额，假设该笔认购按照100%比例全部予以确认，其对应认购费率为0.20%，且该笔认购产生利息100.70元。则其可得到的A类基金份额为：

认购费用＝1,000,000.00/（1＋0.20%）×0.20%＝1,996.00元

净认购金额＝1,000,000.00－1,996.00＝998,004.00元

认购份额＝（998,004.00＋100.70）/1.00＝998,104.70份

例2：某投资者在认购期投资10,000元认购本基金C类基金份额，假设该笔认购按照100%比例全部予以确认，且该笔认购产生利息10.70元。则其可得到的C类基金份额为：

认购份额＝（10,000.00＋10.70）/1.00＝10,010.70份

例3：某养老金客户在认购期通过直销柜台投资500万元认购本基金A类基金份额，假设该笔认购按照100%比例全部予以确认，且这500万元在募集期间产生的利息为5,350.00元，则其可得到的A类基金份额为：

认购费用＝1,000.00元

净认购金额＝5,000,000.00－1,000.00＝4,999,000.00元

认购份额＝（4,999,000.00＋5,350.00）/1.00＝5,004,350.00份

2. 认购份额的计算中，涉及基金份额、费用的计算结果均保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分舍去，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（十四）募集期利息的处理方式

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，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

（十五）募集资金的管理

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

二、机构投资者在网下直销柜台的开户与认购程序

投资者如欲详细了解开户与认购信息，可登陆本公司官方网站（www.orient-fund.com），在"客户服务"---"下载专区"下载相关交易指南。

（1）开户及认购的时间：基金发售日的周一至周五9:00～16:30（周六、日和法定节假日不受理）。

（2）开户及认购程序：

1）法人机构投资者开户需提供下列资料办理开户手续：

①企业法人营业执照复印件；事业法人、社会团体或其他组织需提供民政部门或主管部门颁发的注册登记书复印件（相关证件在有效年检期内）；金融机构应提供开展金融相关业务的资质证书复印件（资质证书为金融机构主营业务的金融许可证，包括但不限于金融许可证、年金、社保、特定客户资产管理证书等）；

②填妥的《基金账户业务申请表（机构）》；

③填妥的《基金业务授权委托书》；

④填妥的《印鉴卡》；

⑤填妥的《传真委托协议书》（适用于选择"传真业务"事项）；

⑥填妥并由经办人签章的《机构投资者销售适当性调查问卷》及相关证明材料，具体见表下备注；

⑦填妥的《非自然人客户受益所有人信息表》及相关证明材料；《机构投资者税收居民身份声明》，《控制人税收居民身份声明》(存在控制人时提供)

⑧预留同名银行账户的《银行开户许可证》，或开立银行账户申请表或开户银行出具的开户证明，相关证明应可确定银行账户与投资者的关系；

⑨法人代表有效身份证件正反面复印件；法人代表授权法人代表授权人时还需提供：法人代表授权人有效身份证件正反面复印件、法人代表对授权人的授权委托书；

⑩经办人有效身份证件原件（临柜时）及正反面复印件。

2）非法人产品开户

资产管理人以管理的投资组合名义（含专户产品投资者）办理账户类业务提供下列资料办理基金的开户手续：

①填妥的《基金账户业务申请表（产品）》

②填妥的《基金业务授权委托书》

③填妥的《印鉴卡》

④《传真委托协议书》(适用于选择"传真业务"事项)

⑤填妥并由经办人签章的《投资者销售适当性调查问卷（机构）》

⑥资产管理人营业执照复印件（相关证件在有效年检期内）

⑦预留产品同名银行账户的《银行开户许可证》或开立银行账户申请表或开户、托管银行出具的开户证明，相关证明应可确定银行账户与产品的关系

⑧资产管理人法人代表的身份证件正反面复印件

⑨法人代表授权法人代表授权人时还需提供：法人代表授权人有效身份证件正反面复印件、法人代表对授权人的授权委托书

⑩提供开展金融相关业务的资质证书（资质证书应为对应产品类型的年金、社保、QFII、特定客户资产管理证书等）

11)经办人有效身份证件原件（临柜时）及正反面复印件

12)《非自然人客户受益所有人信息表》及相关证明材料

13)专户理财产品：须提供证监会出具产品备案登记证明，或是向证监会报备的书面文件材料或相关证明文件

如不能提供时，一对一产品须提供产品合同首尾页或成立公告（如有），合同应为托管人、管理人、投资者三方合同或托管人与管理人、管理人与投资者签订的合同，成立公告、合同应加盖公章或同等效力部门业务章；一对多产品须首先提供成立公告，若无公告时提供托（保）管合同（相关页）一份及说明，材料均须加盖公章或同等效力部门业务章。

保险产品：须提供保监会出具的备案报送材料清单表。

若拟开户名称与保险品种不一致时须提供相关说明。

保险公司委托资产管理公司为其保险产品办理开户、投资时，须提供该保险公司与资产管理公司签署的委托协议复印件并加盖公章或同等效力部门业务章。

信托产品：提供该信托产品的设立证明文件（合同首末页或其他书面文件），材料加盖信托公司公章。

QFII 产品

a.QFII 委托托管人/管理人办理基金账户业务的授权委托书

b.证监会颁发的QFII 证券投资业务许可证复印件（加盖托管部门章）

c.国家外汇管理局关于批准QFII 的投资额度以及开立相关账户的批复的复印件

d.中国证监会颁发的关于合格境外机构投资者资格的批复的复印件

3）企业年金计划、社保基金组合等办理账户类业务

提供下列资料办理基金的开户手续：

账户管理人提供：

①填妥的《基金账户业务申请表（产品）》

②填妥的《基金业务授权委托书》

③填妥的《印鉴卡》

④账户管理人依法设立并有效存续的营业执照；提供开展金融相关业务的资质证书复印件（资质证书应为对应产品类型的年金、社保、QFII、特定客户资产管理证书等）

⑤企业年金、社保基金另需提供监管部门如下批复文件：

企业年金：人力资源和社会保障部（厅）向年金出具的备案确认文件、企业年金计划托管、投资管理合同（首尾页）或能证明各方运作关系的其他书面文件，相关文件须加盖账户管理人和投资管理人公章或同等效力部门业务章。

社保基金：全国社保基金理事会出具的社保产品批复、社保基金托管、投资管理合同（首尾页）或能证明各方运作关系的其他书面文件，相关文件须加盖社保基金账户管理人和投资管理人公章或同等效力部门业务章。

⑥账户管理人法人代表身份证件正反面复印件

法人代表授权法人代表授权人时还需提供：法人代表授权人有效身份证件正反面复印件、法人代表对授权人的授权委托书

⑦账户类经办人身份证件原件（临柜时）及正反面复印件。

⑧预留产品同名银行账户的《银行开户许可证》或开立银行账户申请表或开户银行出具的开户证明，相关证明应可确定银行账户与产品的关系

⑨填妥的《非自然人客户受益所有人信息表》及规定证明材料

交易管理人提供：

⑩资产管理人营业执照（相关证件在有效年检期内）；提供开展金融相关业务的资质证书复印件（资质证书应为对应产品类型的年金、社保、QFII、特定客户资产管理证书等）

11)填妥并加盖公章的办理交易类业务《印鉴卡》

12)交易经办人有效身份证件原件（临柜时）及正反面复印件

13)交易管理人法人代表身份证件正反面复印件；法人代表授权法人代表授权人时还需提供：法人代表授权人有效身份证件正反面复印件、法人代表对授权人的授权委托书

14)《传真委托协议书》(适用于选择"传真业务"事项)

15)填妥并由交易经办人签章的《投资者适当性调查问卷(机构)》

16)填妥的《基金业务授权委托书》

4）认购资金的缴付

以银行转账方式将足额认购资金汇入本公司指定银行开立的直销资金专户，本公司指定的直销资金专户如下：

名称：东方基金管理股份有限公司

账号：11001007300059507311

开户行：中国建设银行北京中关村分行

投资者若因未向上述指定账户足额划付认购资金，造成其认购不成功的，本公司将不承担任何责任。

5）认购申请：投资者开户同时可办理认购手续，并需提供下列资料：

①填写完整并加盖预留印鉴和授权经办人签字的《基金交易业务申请表》（原件）；

②认购资金已划出的有效凭证，包括但不限于加盖银行受理章的银行付款凭证/划款回单联原件及复印件（投资者划付的认购资金在办理认购手续时未到达本公司指定的直销资金专户时）；

（3）注意事项：

1）投资者应在"汇款人"栏中填写其在基金直销机构开户时登记的名称；

2）投资者应在认购申请当日17:15之前将足额资金划入本公司指定的基金直销资金专户。若认购资金在投资者提出认购申请当日未到达本公司指定基金直销资金专户，则该笔交易无效。

3）基金募集期结束，以下将被认定为无效认购：

①投资者已划付认购资金，但逾期未办理开户手续或开户不成功的；

②投资者已划付认购资金，但逾期未办理认购手续的；

③投资者已划付的认购资金少于其申请的认购金额的；

④本公司确认的其它无效资金或认购失败资金。

4）在基金登记机构确认为无效认购后，投资者可以就已到账资金再次提出认购申请，未再次提出认购申请的由本公司将认购款划往投资者认购款划出银行账户。

三、机构投资者在其他销售机构办理开户与认购

机构投资者在其他销售机构的开户及认购程序以其他销售机构的规定和说明为准。

四、清算与交割

1. 基金合同生效前，全部认购资金将被冻结在本基金募集专户中，有效认购款项在募集期间产生的利息，在基金合同生效后折算为基金份额归基金份额持有人所有，利息以登记机构的记录为准。

认购资金利息计算结果保留小数点后2位，小数点后2位以后的部分舍去，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2. 本基金权益登记由基金登记机构在募集结束后完成。

五、基金的验资与基金合同生效

1. 本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。

2. 基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3. 基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

4. 如基金募集失败，基金管理人应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30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

六、本次份额发售当事人和中介机构

（一）基金管理人

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市丰台区金泽路161号院1号楼远洋锐中心26层

法定代表人：崔伟

电话：010-66295888

传真：010-66578700

联系人：李景岩

客户服务电话：400-628-5888

网址：www.df5888.com或www.orient-fund.com

（二）基金托管人

名称：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

法定代表人：张为忠

成立日期：1992年10月19日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复(1992)601号文

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币293.52亿元

经营期限：永久存续

（三）直销机构

名称：东方基金管理股份有限公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：海南省海口市龙华区滨海大道77号中环国际广场21层

法定代表人：崔伟

联系人：李媛

电话：0898-68666597

传真：0898-68666580

网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（四）其他销售机构

1、东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

2、华鑫证券有限责任公司

住所：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：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

电话：021-54967552

传真：021-54967293

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

3、中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李峰

联系人：李明娟

电话：021-20315290

传真：021-20315125

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

4、上海利得基金销售有限公司

住所：上海宝山区蕰川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然

电话：021-50583533

传真：021-50583633

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

5、上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：黄祎

联系人：张戈

电话：021-50712782

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

6、珠海盈米基金销售有限公司

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：李孟军

联系电话：020-89629012

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

7、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

办公地址：西直门外大街1号 西环广场T2 19C13

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

网址： www.hcjijin.com

8、上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：李鑫

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话： 400-820-5369

网址：https://www.jiyufund.com.cn/

9、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号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：屠彦洋

电话：95021

传真：021-64385308

客户服务电话：400 1818 188

网址：www.1234567.com.cn

10、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路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

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服电话：400 700 9665

网址：www.ehowbuy.com

11、深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

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

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：400 678 8887

网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

12、诺亚正行基金销售有限公司

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楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

联系电话：021-38509735

传真：021-38509777

客服：400-821-5399

网址： http://www.noah-fund.com/

（五）基金份额登记机构

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市丰台区金泽路161号院1号楼远洋锐中心26层

法定代表人：崔伟

联系人：张力苍

电话：010－66295874

传真：010－66578680

网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（六）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

负责人：韩炯

联系人：丁媛

电话：021-31358666

传真： 021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

（七）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：上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼

办公地址：上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼

法定代表人：李丹

联系人：蔡晓慧

电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：张勇、蔡晓慧

东方基金管理股份有限公司

2024年5月6日

东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告

东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金合同全文和招募说明书全文于2024年5月6日在本公司网站[www.orient-fund.com或www.df5888.com]和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（400-628-5888）咨询。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

特此公告。

东方基金管理股份有限公司

2024年5月6日