

富达基金管理(中国)有限公司

富达中债0-2年政策性金融债指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1. 富达中债0-2年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已于2024年2月7日获中国证监会监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]290号文准予注册，中国证监会对本基金的注册并不代表其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2. 本基金为契约型开放式证券投资基金，基金类别为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

3. 本基金的基金管理人为富达基金管理（中国）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。同时，招商证券股份有限公司作为基金服务机构，为本基金提供份额登记、估值核算等基金服务。

4. 本基金的发售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。

基金管理人已履行法律法规以及公司内部控制制度的要求，本基金有权拒绝非为中国税收居民、美国人士或不符合基金管理人规定的其他投资者资质条件的投资者（以下称“非合格投资者”，且包含其代理人或授权签字人或控制人，以下同）的认购/申购或以任何方式持有本基金基金份额的行为。并且，本基金目前仅为根据中华人民共和国法律注册的公募基金产品。由于并非所有美国人都适合购买非美国注册的产品，除下文所述的特定情形外，本基金将不直接或间接地向美国人士（或其代理人或授权签字人或控制人，以下同）销售或由美国人士持有。

本条所称的“美国人士”为具有以下标识（“美国标识”）之一的投资者（或其代理人或授权签字人或控制人）：

- (1) 任何的美国地址；
- (2) 美国的银行账号；
- (3) 出生地为美国；
- (4) 美国的电话号码；
- (5) 为美国居民或公民拥有、控制或实际控制的企业；
- (6) 为美国居民或公民通过一项正在进行的交易拥有、控制或实际控制的企业；

(7) 为美国居民或公民（例如双重居住地、美国永久居民）；

(8) 基金管理人认可的境外机构（包括该等机构管理的资产管理产品）作为合格境外投资者投资本公司旗下基金或其他基金经理人合理判断投资本公司旗下基金对基金经理人或本公司旗下基金的运作不构成合规风险的投资者除外。

本基金有权拒绝非为中国税收居民、美国人士或不符合基金管理人规定的其他投资者资质条件的投资者（以下并称“非合格投资者”）的认购/申购申请或以任何方式持有本基金基金份额的行为，为此，基金管理人、销售机构或其授权的第三方有权拒绝非合格投资者的认购/申购（含定期定额投资），转换转入申请人申请或以任何方式持有本基金基金份额的行为，且有权拒绝任何非合格投资者开立基金账户或采取强制赎回、冻结基金账户等其他相应控制措施，并要求赔偿因此而遭受（或可能遭受）的损失。投资者应当按照相关法律法规及基金管理人的要求，及时向基金管理人、销售机构或其授权的第三方如实、准确、完整地提供有效的税收居民声明文件及证明文件，前述信息资料发生变更的，投资者应在30天内告知基金管理人、销售机构或其授权的第三方，并提供变更后的有效的税收居民声明文件及证明文件。属于上述“美国人士”的投资者，不得通过任何方式投资于本基金。基金经理人及基金经理人投资基金的“买者自负”原则，在作出投资决策后，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。

本基金单一投资者持有所有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的20%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等形式导致被动达到或超过20%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

《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，本基金将根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。因此投资者可能面临基金合同自动终止的风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相

应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制的特定风险。

基金管理人依据相关法律、法规及核准设立批复等，经尽职调查，进行了充分的评估论证，履行了必要的决策程序，将份额登记、估值核算等业务委托给基金管理人——招商证券股份有限公司负责日常运营；基金管理人需定期了解基金服务机构的人员配备情况、业务操作的专业能力、业务隔离措施、软硬件设施等基本运作情况，以保证满足业务发展的实际需求；如前述提供份额登记、估值核算的基金服务机构发生变更的，基金管理人需另行发布相关公告。若基金份额持有人不同意基金管理人变更基金服务机构的，自公告之日起10日内可以赎回其持有的全部基金份额，若基金份额持有人自公告之日起10日后继续持有全部或部分基金份额的，视为其同意基金管理人变更基金服务机构。

基金经理人及基金经理人投资基金的持有人以其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强开户管理及可疑交易报告后续控制措施的通知》、《中国人民银行关于落实执行联合国安理会相关决议的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定，承诺用于基金投资的资金来源不属于违法所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，不借助本公司进行洗钱、恐怖融资等违法犯罪活动。基金经理人及基金经理人投资基金的持有人承诺，其不属于联合国、中国有权机关或其他司法管辖区有管辖权机关制裁名单内的企业或个人，不位于被联合国、中国有权机关或者其他司法管辖区有管辖权机关制裁的国家和地区。

基金经理人依据相关法律、法规及核准设立批复等，经尽职调查，进行了充分的评估论证，履行了必要的决策程序，将份额登记、估值核算等业务委托给基金管理人——招商证券股份有限公司负责日常运营；基金管理人需定期了解基金服务机构的人员配备情况、业务操作的专业能力、业务隔离措施、软硬件设施等基本运作情况，以保证满足业务发展的实际需求；如前述提供份额登记、估值核算的基金服务机构发生变更的，基金管理人需另行发布相关公告。若基金份额持有人不同意基金管理人变更基金服务机构的，自公告之日起10日内可以赎回其持有的全部基金份额，若基金份额持有人自公告之日起10日后继续持有全部或部分基金份额的，视为其同意基金管理人变更基金服务机构。

基金经理人及基金经理人投资基金的持有人以其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强开户管理及可疑交易报告后续控制措施的通知》、《中国人民银行关于落实执行联合国安理会相关决议的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定，承诺用于基金投资的资金来源不属于违法所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，不借助本公司进行洗钱、恐怖融资等违法犯罪活动。基金经理人及基金经理人投资基金的持有人承诺，其不属于联合国、中国有权机关或其他司法管辖区有管辖权机关制裁名单内的企业或个人，不位于被联合国、中国有权机关或者其他司法管辖区有管辖权机关制裁的国家和地区。

1. 成份券停牌或违约的风险、投资政策性金融债的风险等。

本基金主要投资于政策性金融债，可能面临政策性银行改制后的信用风险、流动性风险、投资集中度风险等。

本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金为指型基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

本基金的指数为中债0-2年政策性金融债指数。

本基金的指数选取方法：

(1) 债券种类：政策性银行债券，不包含二级资本债、次级债。

(2) 上市地点：全国银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所。

(3) 发行方式：公开发行。

(4) 债券余额/发行量：无限制。

(5) 债券剩余期限：0-2年（包含2年）。

(6) 债券币种：人民币。

(7) 付息方式：附息式固定利率、利随本清、贴现。

(8) 含权债：不包含含权债。

(9) 取价原则：以中债估值为参考（价格偏离度参数为0.1%），优先选取合理的最优市场价格，若无则直接采用中债估值。指数成分券中，不同场所流通的一支券作为不同券别。

(10) 成分券权重：市值加权法。

有关标的指数具体编制方案及成份券信息详见中国债券信息网网站，网址：<https://www.chinabond.com.cn/>。

本基金初始面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损、因折算、分红等行为导致基金净值净变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等信息披露文件，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，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不代表未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者投资基金的“买者自负”原则，在作出投资决策后，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。

基金管理人有权拒绝非为中国税收居民、美国人士或不符合基金管理人规定的其他投资者资质条件的投资者（以下并称“非合格投资者”）的认购/申购申请或以任何方式持有本基金基金份额的行为。并且，本基金目前仅为根据中华人民共和国法律注册的公募基金产品。由于并非所有美国人都适合购买非美国注册的产品，除下文所述的特定情形外，本基金将不直接或间接地向美国人士（或其代理人或授权签字人或控制人，以下同）销售或由美国人士持有。

本条所称的“美国人士”为具有以下标识（“美国标识”）之一的投资者（或其代理人或授权签字人或控制人）：