

中海基金管理有限公司关于中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同、招募说明书的公告

中海基金管理有限公司（以下简称“我公司”）旗下中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立于 2016 年 4 月，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）。现根据中国证券监督管理委员会最新制定的《通过港股通机制参与香港股票市场交易的公募基金注册审核指引》（以下简称“《审核指引》”）的指导精神以及中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《关于进一步加强辖区通过港股通机制参与香港股票市场交易的基金产品监管的通知》（以下简称“《通知》”），我公司经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定对《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）相关内容进行相应的补充和调整，现将有关修订内容公告如下：

修改前《中海沪港深价值优选灵活配置

混合型证券投资基金基金合同》 修改后《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

第一部分 前言

六、本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票，将承担汇率风险以及境外市场的风险。 第一部分 前言

六、本基金投资相关股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通”）试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

增加：

特别风险提示：

基金名称仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资者比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

第十二部分 基金的投资

六、风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

第十二部分 基金的投资

六、风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

修改前中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 修改后中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

重要提示

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。重要提示

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

增加：

基金管理人在此特别提示投资者：基金名称仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的投资者比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

九、基金的投资

(八) 风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

九、基金的投资

(八) 风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

十七、风险揭示

(五) 本基金特有风险

2、港股通机制下的港股投资风险：

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪港通机制下允许投资的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的股票,除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的的构成、制度安排以及交易规则等差异所带来的特有风险,包括但不限于：

……

(2) 股价波动的风险：

香港联交所实行 T+0 回转交易制度，即投资者当天买入的股票可以当天卖出，同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

.....

(5) 港股通交易日设定的风险:

由于沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，所以存在即使香港联交所开市，本基金也无法进行港股通交易的情形。这可能导致本基金存在因交易日不连贯所带来的价格波动影响港股投资并给基金利益造成损失的风险。

十七、风险揭示

(五) 本基金特有风险

2、港股通机制下的港股投资风险:

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪港通机制下允许投资的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的股票,除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险,包括但不限于:

.....

(2) 股价波动的风险:

香港联交所实行 T+0 回转交易制度，即投资者当天买入的股票可以当天卖出，同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

.....

(5) 港股通交易日设定的风险:

由于沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，所以存在即使香港联交所开市，本基金也无法进行港股通交易，港股不能及时卖出的情形。这可能导致本基金存在因交易日不连贯所带来的价格波动影响港股投资并给基金利益造成损失的风险。

《基金合同》和《招募说明书》的其他内容不变。

根据《基金合同》对于基金份额持有人大会召开事由的约定，本次变更属于“因相应的法律法规发生变动而对《基金合同》进行修改”的情况，故可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，不需召开基金份额持有人大会。

修改后的《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自本公告发布之日起（含）起生效。

重要提示:

1、本基金将在最近一次更新招募说明书及摘要时对上述修改内容进行更新。

2、基金管理人于本公告发布当日，将修改后的《基金合同》登载于基金管理人网站。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及相关法律文件。

3、投资者可通过本公司客服电话 400-888-9788 或 021-38789788 咨询有关详情，也可登陆本公司网站（www.zhfund.com）获取相关信息。

风险提示：

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，由投资人自行承担。投资者投资基金时应认真阅读基金的《基金合同》等文件。

本公告的解释权归中海基金管理有限公司。

特此公告。

中海基金管理有限公司

2017 年 7 月 20 日