

# 华泰保兴基金管理有限公司

## 关于调整旗下部分公募基金投资范围并相应修订基金合同等 法律文件的公告

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信息披露管理办法》、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》、《公开募集证券投资基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，对于基金参与存托凭证投资、全国中小企业股份转让系统挂牌精选层股票（简称“新三板精选层股票”）投资，华泰保兴基金管理有限公司（以下简称“公司”）对旗下 11 只公募基金的基金合同等法律文件进行修订，修订包括明确投资范围包含存托凭证和新三板精选层股票、增加存托凭证和新三板精选层股票的投资策略、投资比例限制、估值方法等，并在基金合同、基金招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）中增加投资存托凭证和新三板精选层股票的风险揭示。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订将自 2021 年 3 月 5 日起正式生效。现将基金合同、招募说明书（更新）修订情况公告如下：

### 一、本次调整投资范围的基金

序号	基金代码	基金名称
1	A 类 004374/ C 类 004375	华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金
2	A 类 005169/ C 类 005170	华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
3	005522	华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
4	A 类 005904/ C 类 005905	华泰保兴成长优选混合型证券投资基金
5	A 类 005908/ C 类 005909	华泰保兴尊利债券型证券投资基金
6	A 类 006385/ C 类 006386	华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金
7	006642	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金
8	007385	华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

9	A类 006882/ C类 006883	华泰保兴健康消费混合型证券投资基金
10	007586	华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金
11	A类 009124/ C类 009125	华泰保兴科荣混合型证券投资基金

## 二、基金合同及招募说明书（更新）修订

基金合同和招募说明书（更新）具体修订如下：

1、在基金合同“前言”及招募说明书（更新）“重要提示”部分，补充了风险揭示，具体如下：

“六、本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分资产投资于全国中小企业股份转让系统（以下简称“新三板”）精选层股票或选择不将基金资产投资于新三板精选层股票，基金资产并非必然投资新三板精选层股票。本基金投资新三板精选层股票，可能面临流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、挂牌公司终止挂牌风险、精选层市场股价波动风险、投资集中风险等。具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

七、本基金投资范围包括中国存托凭证，会面临与境内上市交易股票投资的共同风险，还存在中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与中国存托凭证发行机制相关的风险等。具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。”

2、在基金合同和招募说明书（更新）“释义”部分，补充了新三板精选层股票释义，具体如下：

**“58、新三板精选层股票：指在全国中小企业股份转让系统精选层挂牌并公开转让的股票”**

3、在基金合同和招募说明书（更新）“基金份额的申购与赎回”部分，修改了申购和赎回的开放日及时间，具体如下：

修订前表述	修订后表述
二、申购和赎回的开放日及时间	二、申购和赎回的开放日及时间
1、开放日及开放时间	1、开放日及开放时间
投资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	投资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

证券交易所及相关金融期货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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。	证券交易所及相关金融期货交易所、 <b>全国中小企业股份转让系统</b> 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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
--	--

4、在基金合同和招募说明书（更新）“基金的投资”部分，修改了投资范围，具体如下：

修订前表述	修订后表述
<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券……</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票<b>以及存托凭证</b>）、<b>全国中小企业股份转让系统挂牌精选层股票（简称“新三板精选层股票”</b>）、债券……</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p><b>开放式运作基金补充的条款表述为“投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的 15%。”</b></p> <p><b>定期开放式运作基金补充的条款表述为“在封闭期内，本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的 20%。在开放期内，本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的 15%。”</b></p>

5、在基金合同和招募说明书（更新）“基金的投资”部分，补充了新三板精选层股票和存托凭证的投资策略，具体如下：

#### “4、新三板精选层股票投资策略

本基金将重点关注流动性良好的优质新三板精选层挂牌公司，从定性分析和定量分析两方面进行研究筛选，选取公司赛道空间较大，有一定收入规模，商业模式、潜在盈利能力和持续性较好，市场地位稳固、竞争优势明显的个股进行配置。

##### （1）定性分析

本基金将以公司未来的预期成长性为核心，从公司所在行业的发展状况、公司在行业中的竞争地位、公司的创新能力、商业模式、市场竞争力、公司治理结构等多角度研判公司的成长质量和成长可持续性，精选具有良好成长潜力的新三板精选层挂牌公司纳入本基金的股票投资组合。此外，本基金还将关注新三板精选层挂牌公司股票的交易活跃度和公司的股权分散度。

##### （2）定量分析

A、盈利能力分析。本基金重点考察主营业务收入、ROE、经营现金流等关键指标，以衡量公司各个阶段的盈利能力。

B、成长能力分析。本基金采用年复合营业收入增长率或者净利润增长率指标考察公司的成长性。

C、估值水平分析。本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股票的价值是否被低估，寻找股票的合理价格区间。

#### 5、存托凭证的投资策略

本基金将根据法律法规和监管机构的要求，在深入研究的基础上，重点关注发行人有关信息披露情况和基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，精选出具有比较优势的存托凭证。”

6、在基金合同和招募说明书（更新）“基金的投资”部分，补充了新三板精选层股票和存托凭证的投资限制，具体如下：

开放式运作基金条款表述为“本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的15%；

定期开放式运作基金条款表述为“在封闭期内，本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过基金资产净值的20%。在开放期内，本基金投资于新三板精选层股票的市值不超过

基金资产净值的 15%；”

以下条款对于开放式运作基金和定期开放式运作基金均相同。

(19) 本基金基金财产在新三板市场中仅限于投资精选层股票。所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合。基金所投资新三板精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外；

(20) 本基金持有一家新三板精选层挂牌公司发行的股票市值不得超过基金资产净值的 5%；本基金管理人管理的全部基金持有一家新三板精选层挂牌公司发行的股票，不得超过该股票的 5%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制。因证券/期货市场波动、挂牌公司或上市公司合并、基金规模变动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 20 个交易日内进行调整；

(21) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；”

7、在基金合同和招募说明书（更新）“基金资产估值”部分，修改了估值方法，具体如下：

修订前表述	修订后表述
三、估值方法	三、估值方法
1、证券交易所上市交易的有价证券的估值	1、证券交易所上市交易 <b>或全国中小企业股份转让系统挂牌</b> 的有价证券的估值
(1)交易所上市交易的非固定收益品种(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值；	(1)交易所上市交易 <b>或全国中小企业股份转让系统挂牌</b> 的非固定收益品种(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所 <b>或全国中小企业股份转让系统挂牌</b> 的市价(收盘价)估值；
……	……
(5)交易所上市不存在活跃市场的有价证	(5)交易所上市 <b>或全国中小企业股份转让</b>

<p>券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p>	<p><b>系统挂牌</b>不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所<b>或全国中小企业股份转让系统</b>挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>增加：</p> <p><b>8、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。</b></p>
---	---

8、在基金合同和招募说明书（更新）“基金的信息披露”部分，补充了投资新三板精选层股票、存托凭证的信息披露条款，具体如下：

**“（十三）投资新三板精选层股票的信息披露**

本基金在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与新三板精选层股票交易的相关情况，包括持有的挂牌股票总额、挂牌股票市值占基金资产净值比例、报告期内持有的挂牌股票明细。

**（十四）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。”**

9、在招募说明书（更新）“风险揭示”部分，补充了投资新三板精选层股票及存托凭证的风险提示说明，具体如下：

**“4、本基金投资新三板精选层股票的风险**

**（1）流动性风险：**由于新三板精选层股票的投资者门槛较高，股票流动性弱于其他 A 股板块，投资者可能在特定阶段对新三板精选层股票个股形成一致性预期，因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。

**（2）挂牌公司经营风险：**由于精选层企业规模标准低于 A 股相关市场板块准入标准，

新三板精选层挂牌公司在企业持续经营能力，核心技术、经营、管理团队稳定性，财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等风险的水平上具有较大的经营风险，由此可能导致基金持仓股价的较大负向波动。

(3) 挂牌公司降层风险：新三板市场由包括基础层、创新层和精选层在内的多层次市场组成，精选层挂牌公司在不具备相应条件后具有较大的降层风险，可能给基金净值带来不利影响。

(4) 挂牌公司终止挂牌风险：根据新三板市场过往运行情况，新三板挂牌企业存在相对 A 股相关市场更大的摘牌风险，由此对基金流动性管理、资产处置带来了更大的风险管理压力，更大的终止挂牌风险也可能给基金净值带来不利影响。

(5) 精选层市场股价波动风险：根据《全国中小企业股份转让系统股票交易规则》，全国股转系统对连续竞价股票实行价格涨跌幅限制，跌幅限制比例为 30%，精选层股票采用连续竞价交易，涨跌幅限制大于包括创业板和科创板在内的 A 股市场相关板块，可能给基金净值带来较大的波动风险。

(6) 投资集中风险：新三板精选层挂牌企业主要属于创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。

#### 5、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），除面临与境内上市交易股票投资的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。”

### 三、其他需要提示的事项

1、因上述修订导致的序号变化顺序调整。此外，本公司根据上述修订对上述基金的托管协议涉及前述内容的章节进行了更新和修订，并将在更新的产品资料概要等文件中对上述

内容进行相应修改。以上更新修订内容仅为示例，不同基金的基金合同等法律文件中相应条款表述存在差异，具体请以相关基金披露的修订后法律文件内容为准。

2、本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定，修订自 2021 年 3 月 5 日起生效。本次修订后的《基金合同》、《托管协议》和《招募说明书》将于本公告发布之日在本公司网站（[www.ehuataifund.com](http://www.ehuataifund.com)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）发布。投资者办理基金交易等相关业务前，应仔细阅读各基金的基金合同、招募说明书、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件。

3、投资者可访问本公司网站（[www.ehuataifund.com](http://www.ehuataifund.com)）拨打本公司的客户服务电话 400-632-9090（免长途话费），（021）80210198 咨询相关情况。

**风险提示：**

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责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将来表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营情况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金投资有风险，敬请投资者认真阅读《基金合同》《招募说明书》（更新）等基金相关法律文件，关注基金的投资风险，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

华泰保兴基金管理有限公司

二〇二一年三月五日