

摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型  
证券投资基金  
招募说明书（更新）

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

**【重要提示】**

摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2021年7月30日经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2586号文准予注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应仔细阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等产品法律文件，充分认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，认真考虑本基金存在的各项风险因素，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回本基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，信用风险，本基金的特定风险等。

本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），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。具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

本基金将聘请符合要求的香港机构担任港股投资顾问，在本基金运作过程中，港股投资顾问的投资研究水平、服务能力直接影响本基金收益水平，因此，投资本基金可能面临聘请港股投资顾问引起的特定风险。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

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，可以启动侧袋机制，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时的特定风险。

本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

基金管理人提醒投资人基金投资的“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，由投资人自行负责。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本基金本次更新招募说明书在“第五部分 相关服务机构”增加提供港股投资顾问服务的香港机构，在“第十六部分 风险揭示”相应增加聘请港股投资顾问的风险，相关更新信息截止日为2021年11月5日。除非另有说明，本招募说明书（更新）其他内容截止日为2021年10月21日。

## 目 录

第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	5
第三部分 基金管理人.....	10
第四部分 基金托管人.....	20
第五部分 相关服务机构.....	23
第六部分 基金的募集.....	25
第七部分 基金合同的生效.....	30
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	31
第九部分 基金的投资.....	43
第十部分 基金的财产.....	53
第十一部分 基金资产的估值.....	54
第十二部分 基金的收益与分配.....	60
第十三部分 基金的费用与税收.....	62
第十四部分 基金的会计与审计.....	65
第十五部分 基金的信息披露.....	66
第十六部分 风险揭示.....	72
第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	85
第十八部分 侧袋机制.....	87
第十九部分 基金合同内容摘要.....	90
第二十部分 基金托管协议内容摘要.....	90
第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....	119
第二十二部分 其他应披露事项.....	121
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	122
第二十四部分 备查文件.....	123

## 第一部分 绪言

《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由摩根士丹利华鑫基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人员提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务关系的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会公布的《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、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

19、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

20、合格境外机构投资者：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可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：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，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者

22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和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者的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以及符合《销售办法》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

26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非过户等

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司或接受摩根士丹利华鑫基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、T日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

37、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放申购和赎回等业务）

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守

40、认购：指在基金募集期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

43、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

44、A类基金份额：指收取认购费、申购费，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额

45、C类基金份额：指不收取认购费、申购费，但从本类别基金资产中计提



### 销售服务费的一类基金份额

46、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

47、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

48、定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

49、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额的10%

50、元：指人民币元

51、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

52、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

53、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

55、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

56、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

57、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

58、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

59、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合

法权益不受损害并得到公平对待

60、**港股通**：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

61、**侧袋机制**：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

62、**特定资产**：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

63、**不可抗力**：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

法定代表人：王鸿嫔

成立日期：2003年3月14日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]33号

注册资本：25,000万元人民币

联系人：徐许

联系电话：（0755）88318883

股权结构为：摩根士丹利国际控股公司（49%）、华鑫证券有限责任公司（36%）、深圳市基石创业投资有限公司（15%）。

### 二、主要人员情况

#### （一）董事会成员

周熙先生，上海交通大学理学学士，美国密西根大学安娜堡分校电子工程硕士及工商管理硕士。曾任职于中国联合网络通信集团有限公司上海分公司、爱立信（中国）通信有限公司上海分公司、Ericsson Wireless Communications Inc.、高盛高华证券有限责任公司。2008年加入摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处，历任副总裁、投资银行部执行董事、北京代表处首席代表等职务，2011年起至2021年6月担任摩根士丹利（中国）股权投资管理有限公司及摩根士丹利投资管理咨询（上海）有限公司的董事总经理。目前任考立咨询（广州）有限公司等摩根士丹利国际控股公司关联方所管理基金的投资标的企业（或标的企业的关联方）的董事。现任基金管理人董事长。

俞洋先生，澳门科技大学工商管理硕士，上海财经大学工商管理硕士。曾任常州市证券公司延陵东路营业部总经理、巨田证券有限责任公司无锡营业部总经理、东海证券有限责任公司常州地区中心营业部总经理兼延陵中路营业部总经理、华鑫证券有限责任公司总裁助理、华鑫证券有限责任公司副总裁、华鑫证券有限责任公司总裁、党委副书记、董事、华鑫证券投资有限公司董事长、华鑫期货有限公司董事。目前担任华鑫证券有限责任公司董事长、法定代表人，上海华鑫股份有限公司总经理，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事长、法定代表人。现任基金管理人副董事长。

田明先生，上海交通大学学士、香港中文大学专业会计学硕士。曾任上海

广电（集团）有限公司财务经济部主管、上海广电电子股份有限公司财务会计部经理、上海广电信息产业股份有限公司总会计师、上海华鑫股份有限公司总会计师、华鑫证券有限责任公司财务副总监、总监、财务负责人。目前担任上海华鑫股份有限公司总会计师，上海全创信息科技有限公司董事长、法定代表人。现任基金管理人董事。

孙辰健先生，西安交通大学工业自动化专业学士、西安交通大学经济金融学院产业经济学博士研究生。曾先后担任兰州炼油化工总厂自动化研究所职员、深圳证券交易所电脑工程部业务主任、深圳证券交易所交易运行部副经理、深圳证券交易所西北中心主任、深圳证券通信公司董事、总经理、深圳证券交易所信息管理部总监、中国证券登记结算有限责任公司北京数据技术分公司副总经理和中证信息技术服务有限责任公司党委委员、副总经理、华鑫证券有限责任公司副总经理，华鑫证券投资有限公司法定代表人、董事长。目前担任华鑫证券有限责任公司监事会主席，华鑫宽众投资有限公司法定代表人、董事长。现任基金管理人董事。

高杰文（Todd Coltman）先生，于加利福尼亚州立大学获得本科和研究生学位，并在乔治敦大学取得法律学位。曾在年利达律师事务所（Linklaters）伦敦、香港和东京办公室以及众达律师事务所（Jones Day）的东京办公室担任律师。2004年加入摩根士丹利，负责亚洲地区不动产投资（REI）业务的不动产收购融资。2007年至2009年担任日本REI业务运营总监，自2016年起至今担任摩根士丹利亚洲所有投资管理业务运营总监。目前担任摩根士丹利商务咨询（上海）有限公司董事、摩根士丹利资产服务咨询（中国）有限公司董事、Morgan Stanley Properties Advisory Corp. Limited（成立于开曼群岛）董事、MSP China Holdings Limited（成立于开曼群岛）董事，Canton Pacific Limited（成立于中国香港）董事。现任基金管理人董事。

侯杰明（Jeremy Alton Huff）先生，杜克大学文学学士，哈佛大学法学博士。曾任美国世达律师事务所律师、NBA中国法律副总监、NBA中国品牌娱乐的副总裁。2017年3月至今任摩根士丹利董事总经理并担任中国首席运营官。目前担任摩根士丹利国际银行（中国）有限公司董事、摩根士丹利管理服务（上海）有限公司董事，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司监事，摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处普通代表。现任基金管理人董事。

王鸿嫔女士，台湾国立清华大学法学学士。曾任怡富证券投资信托有限公司副总经理，怡富证券投资顾问公司总经理，上投摩根基金管理有限公司总经理，上海富汇财富管理股份有限公司董事长兼总经理等。现任基金管理人董事、总经理。

贾丽娜女士，东北财经大学商业经济系学士、东北财经大学商业经济系硕

士。曾于金陵科技学院任教，1994年8月至今2017年11月任天衡会计师事务所注册会计师、高级合伙人，2017年11月起至今任中天运会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人，目前兼任倍加洁集团股份有限公司和江苏林洋能源股份有限公司和厦门特宝生物工程股份有限公司独立董事。现任基金管理人独立董事。

彭章键先生，中国人民大学法学硕士。曾任职于海南省高级人民法院、广东信达律师事务所。2008年至今担任北京市中银（深圳）律师事务所合伙人，兼任华南经济贸易仲裁委员会和深圳仲裁委员会仲裁员，广东省知识产权局入库专家。现任基金管理人独立董事。

苗复春先生，中国人民大学经济学硕士。曾任内蒙古商业局、计委科长，中国社科院技术经济研究所助理研究员，国务院技术经济研究中心研究员，国务院办公厅副局长，外经贸部办公厅主任，中央财经领导小组办公室局长，中国人寿保险公司副总经理，中国人寿保险股份有限公司执行董事、执行副总裁、副董事长，中国人寿保险集团公司党委副书记、副总裁。退休后曾任中国人寿养老保险公司顾问，兼任中国生产力学会副会长。现任基金管理人独立董事。

Carlos Alfonso OYARBIDE SECO先生，西班牙巴塞罗那自治大学经济学学士，宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士。曾任职于大通曼哈顿银行（纽约办公室）、瑞银集团菲利普斯&德鲁（伦敦办公室），1993年7月至2015年12月期间曾任摩根士丹利欧洲有限公司兼并与收购部董事总经理，摩根士丹利亚洲有限公司兼并与收购部董事总经理，摩根士丹利西班牙有限公司首席执行官，瑞士信贷集团董事总经理、亚太区金融机构部主管，摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处董事总经理和摩根士丹利中国首席营运官。目前担任新黄河资本有限公司创始人及首席执行官。现任基金管理人独立董事。

## （二）监事会成员

赵恒先生，西安大学计划统计学学士，上海财经大学工商管理硕士。曾任中国人民银行西安分行干部、西安证券有限责任公司总经理、华鑫证券有限责任公司总监、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事、华鑫证券有限责任公司副总裁。目前担任上海华鑫股份有限公司副总经理兼任华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司董事长。现任基金管理人监事长。

莫壮伟（Tuangwei Mok）先生，加州大学伯克利分校学士、加州大学伯克利分校哈斯商学院硕士。曾经在瓦乔维亚证券负责发行结构化和证券化产品，并在安永会计师事务所提供企业融资咨询服务。2010年9月加入摩根士丹利亚太区的市场风险团队。2014年加入摩根士丹利投资风险团队，目前担任摩根士丹利投资风险管理的执行董事。现任基金管理人监事。

周苑洁女士，华东政法大学国际经济法法学学士，复旦大学管理学院工商

管理硕士。曾任大鹏资产管理有限责任公司客户关系管理经理。2004年加入基金管理人，历任客户服务中心负责人、上海理财中心负责人、营销策划经理、市场发展部总监助理、销售服务部总监，目前担任基金管理人市场发展部总监。现任职工监事。

谢先斌先生，浙江大学计算科学与工程学专业学士，上海交通大学安泰经济与管理工商管理专业硕士。曾任中国移动（深圳）有限公司软件工程师，及招商基金管理有限公司信息技术部业务经理，基金事务部业务经理、高级经理、首席注册登记师。2011年5月加入基金管理人，曾任基金运营部副总监，目前担任基金运营部总监。现任职工监事。

### （三）公司高级管理人员

周熙先生，董事长，简历同上。

王鸿嫔女士，总经理、董事，简历同上。

李锦女士，哥伦比亚大学、伦敦商学院和香港大学联合授予工商管理学硕士、吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士，24年证券基金行业工作经历。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员。2003年9月加入基金管理人，曾任基金运营部副总监、总监，总经理助理，督察长。现任基金管理人副总经理。

许菲菲女士，中南财经大学国际会计专业学士，19年证券基金行业工作经历。曾任深圳市华新股份有限公司会计，宝盈基金管理有限公司基金会计。2005年6月加入基金管理人，历任基金运营部基金会计，监察稽核部高级监察稽核员、总监助理、副总监、总监。现任基金管理人督察长。

ZHOU HAN（周涵）先生，塔夫茨大学电气工程和计算机工程系博士，6年证券从业经历。曾任中国邮电部北京电信局工程师，美国富达投资集团网络技术总监，Codent Networks, Inc. 副总裁，InfoGlyph USA, Inc. 中国区经理，Locis Software Inc. 总经理，Fidelity（大连）商务服务有限公司交付副总裁，FIL（大连）科技有限公司总经理兼技术部负责人等。2020年7月加入基金管理人，现任基金管理人首席信息官。

### （四）本基金基金经理

王大鹏先生

中山大学金融学博士，注册会计师（CPA），13年证券从业经历。曾任长春工业大学工商管理学院金融学专业教师，宝盈基金管理有限公司医药行业研究员。2010年12月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，历任研究管理部研究员、总监助理、副总监，现任研究管理部总监、基金经理。2015年1月至2017年6月担任摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2016年2月至2017年4月担任摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年6月起担任摩根士丹利华鑫健康产业混合

型证券投资基金基金经理，2017年5月起担任摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金基金经理，2017年6月至2018年12月担任摩根士丹利华鑫品质生活精选股票型证券投资基金基金经理，2017年6月起担任摩根士丹利华鑫卓越成长混合型证券投资基金基金经理，2018年12月起担任摩根士丹利华鑫消费领航混合型证券投资基金基金经理，2020年12月起担任摩根士丹利华鑫内需增长混合型证券投资基金基金经理

#### （五）投资决策委员会成员

主任委员：何晓春，助理总经理、权益投资部总监、基金经理。

副主任委员：李轶，助理总经理、固定收益投资部总监、基金经理。

委员：王大鹏，研究管理部总监、基金经理；余斌，数量化投资部总监、基金经理；李功舜，交易管理部总监。

秘书：王大鹏，研究管理部总监、基金经理。

#### （六）上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有

人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守法律法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3、本基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制



制度，采取有效措施，禁止基金财产用于下列投资或活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

4、基金管理人承诺严格遵守法律法规，禁止发生下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

5、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反《基金合同》或《托管协议》；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- （7）泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （9）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （10）其他法律法规、中国证监会及基金合同禁止的行为。

## 6、基金经理承诺

- （1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- （2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- （3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

- （1）保证基金管理人的经营运作严格遵守法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；
- （2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；
- （3）确保基金、基金管理人应披露的信息真实、准确、完整、及时；
- （4）确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

### 2、内部控制原则

- （1）健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- （2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。
- （3）独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、基金管理人固有财产、其他财产的运作必须相互分离。
- （4）相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置须权责分明、相互制衡。

（5）成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 3、内部控制体系

基金管理人的内部控制体系结构是一个分工明确、相互制约的组织结构，具体包括：

（1）董事会负责决定基金管理人内部管理机构 settings、制定基金管理人基本管理制度，对确保基金管理人建立及维持适当而有效的内部控制负有最终责任。董事会下设的风险控制和审计委员会负责审核基金管理人内部控制制度、检查公司和基金运作的合法合规情况等事项，并向董事会汇报。

（2）经营管理层负责组织设计公司的内部控制制度，拟订公司的基本管理制度和制定公司的部门业务规章，并确保公司的日常经营运作活动合法合规。

（3）督察长负责监督检查基金管理人运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并依据相关规定可独立向董事会和中国证监会报告。

（4）经营管理层下设的风险管理委员会协助经营管理层实施对各类业务和风险的总体控制以及解决公司内部控制中出现的问题。

（5）风险管理部负责跟踪和报告投资管理中的市场风险，评价基金投资业绩，并根据风险收益情况及时提出改进意见，为投资业务的稳健发展提供支持。

（6）监察稽核部独立于基金管理人其他部门和业务活动，对基金管理人内部控制制度、风险管理政策和措施的执行情况实行严格检查和及时反馈，并向督察长、风险管理委员会和经营管理层定期或不定期报告。

（7）各业务部门及员工对风险管理负有直接责任。各业务部门负责人在权限范围内，执行公司的各项风险管理程序，负责本部门业务风险的识别、监控，对本部门的风险管理负全部责任。每一位员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险管理理念和控制措施落实到每一个业务环节当中，并在发现风险隐患和问题时负有报告、反馈和改进的义务。

### 4、内部控制措施

（1）建立合理、完备、有效并易于执行的内部控制制度体系。基金管理人内部控制制度体系由不同层面的制度构成，按照其所管理的层次可以分为四个级别：第一级别是公司章程；第二级别是公司内部控制大纲；第三级别是公司基本管理制度；第四级别是公司各委员会、各部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。基金管理人根据业务需要持续修订和更新各项制度，使其内部控制制度体系日趋完善。

（2）建立浓厚的风险管理文化。经营管理层牢固树立内控优先的风险管理理念，注重培养全体员工的风险防范意识，通过制度约束、学习培训使全体员

工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险管理意识深入人心，并贯穿到各个业务环节。

（3）建立严密有效的内控防线。依据自身经营特点，基金管理人建立起各岗位的自控与互控、相关部门之间的监督制衡、监察稽核部和督察长的独立监督等内控防线。

（4）建立并持续完善风险管理体系。基金管理人通过建立风险分类、识别、评估、报告及监督等程序，定期或不定期地对风险进行评估、预警，并通过清晰的汇报路径，使相关部门及经营管理层即时把握风险状况，及时、快速地采取风险控制措施。

（5）强化风险管理措施。随着业务发展及技术进步，基金管理人开始更多地采取系统化监控措施，增强风险管理的全面性、实时性和有效性。同时，采用数量化分析方法，提高风险管理的科学性。

#### 5、基金管理人关于内部控制制度的声明

（1）本基金管理人确知建立、实施、维持和完善内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任；

（2）本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）本基金管理人承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服

务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号；2020年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## （二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近310名，其中具有高级职称的专家60名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## （三）基金托管业务经营情况

截止到2021年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共620只。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全

完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

## （二）内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

## （三）内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

（一）电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

（二）书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

（三）书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### （一）直销机构

##### 1、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司直销中心

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

联系人：时亚蒙

电话：（0755）88318898

传真：（0755）82990631

##### 2、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司

注册地址：北京市东城区安定门外大街208号院1号楼12层1205单元

办公地址：北京市东城区安定门外大街208号院1号楼12层1205单元

联系人：张宏伟

电话：（010）87986888

传真：（010）87986889

##### 3、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司上海分公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元

联系人：朱冰楚

电话：（021）63343311-2100

传真：（021）50429808

##### 4、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司网上直销系统

交易系统网址：[etrade.msfnfunds.com.cn/etrading](http://etrade.msfnfunds.com.cn/etrading)

目前已开通建设银行、农业银行、银联通、快付通等支付渠道以及基金汇款交易业务。支持银联通渠道、快付通渠道支付的银行卡详见基金管理人官方网站（[www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)）。以上支付渠道支持的银行卡均指银行借记卡，信用卡等贷记卡不支持购买基金。

全国统一客服电话：400-8888-668

客户服务信箱：[Services@msfnfunds.com.cn](mailto:Services@msfnfunds.com.cn)

深圳、北京或上海的投资人单笔认购金额超过100万元（含100万元）人民币的，可拨打直销中心的上述电话进行预约，基金管理人将提供上门服务。



## （二）其他销售机构

其他销售机构情况详见本基金基金份额发售公告或其他调整销售机构的公告。

### 二、登记机构

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

法定代表人：王鸿嫔

联系人：赵恒

电话：（0755）88318709

### 三、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

注册地址：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：安冬

电话：021-31358666

经办律师：安冬、陆奇

### 四、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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：施翊洲

经办注册会计师：单峰、施翊洲

### 五、提供港股投资顾问服务的香港机构

名称：摩根士丹利亚洲有限公司（Morgan Stanley Asia Limited）

注册地址：香港中环康乐广场一号怡和大厦46层

办公地址：香港九龙柯士甸道西一号环球贸易广场3、8、9、30-32、35-42以及45-47

成立时间：1984年3月9日

管理证券资产规模（2020会计年度）：682,935,340,000港元

主要负责人：高杰文（Todd Coltman）

联系电话：+852 2848 6722

联系人：Queenie Leung

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同，经中国证监会2021年7月30日证监许可【2021】2586号文件准予注册。

### 一、基金名称：

摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金

### 二、基金类别

混合型

### 三、存续期间

不定期

### 四、基金的运作方式

契约型开放式

### 五、募集方式

通过各销售机构公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

### 六、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、合格境外机构投资者、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者。

### 七、募集期限

本基金的募集期自基金份额发售之日起不超过3个月（具体发售时间详见本基金基金份额发售公告）。

### 八、募集场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及本基金其他销售机构的销售网点公开发售（具体名单参见本基金基金份额发售公告及相关公告）。

### 九、最低募集份额总额和募集限额

本基金最低募集份额总额为2亿份，最低募集金额为2亿元人民币。本基金可设置首次募集规模上限，超过募集规模上限时基金管理人可以采用比例确认或其他方式进行确认，具体募集上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受此募集规模的限制。

## 十、基金份额类别设置

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：

计算日某类基金份额净值=该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规规定及基金合同约定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售、取消某基金份额类别、对基金份额分类办法及规则等，调整实施前基金管理人需及时公告，不需召开基金份额持有人大会。

## 十一、基金份额发售面值、认购价格、认购费用及计算公式

- 1、本基金份额的发售面值为人民币1.00元。
- 2、本基金认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
- 3、认购费用：

认购本基金A类基金份额收取认购费用。认购本基金C类基金份额不收取认购费用，而是基金合同生效后从本类别基金资产中计提销售服务费。募集期投资者可以多次认购本基金，对于多次认购本基金A类基金份额的，按单笔认购金额对应的费率档次分别计费。各销售机构销售的份额类别以其业务规定为准，敬请投资者留意。

本基金A类基金份额对通过直销中心认购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率。

养老金客户指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，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、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，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率见下表：

（单位：元）

认购金额（M）	认购费率
M < 100 万元	0.48%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.32%
M ≥ 500 万元	每笔1000元

其他投资者认购本基金A类基金份额认购费率见下表：（单位：元）

认购金额（M）	认购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
M ≥ 500 万元	每笔1000元

基金认购费用不列入基金资产，主要用于基金的市场推广、销售、注册与过户登记等募集期间发生的各项费用。

#### 4、认购本基金A类基金份额的计算公式

投资人认购时所交纳的认购金额包括认购费用和净认购金额。认购份额的计算公式如下：

1) 认购费用适用比例费率的情形下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期间的利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

2) 认购费用适用固定金额的情形下：

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+认购期间利息）/基金份额发售面值

认购费用以人民币元为单位，计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入；认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例：某非养老金客户投资100,000元认购本基金A类基金份额，对应费率为1.20%，假设认购利息为19.76元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额=100,000/（1+1.20%）=98,814.23元

认购费用=100,000-98,814.23=1,185.77元

认购份额=（98,814.23+19.76）/1.00=98,833.99份

即该非养老金客户投资100,000元认购本基金A类基金份额，若该笔资金在募集期间的利息为19.76元，则可得到98,833.99份A类基金份额。

#### 5、认购本基金C类基金份额的计算方式

C类基金份额不收取认购费，而是自基金合同生效之日起，从本类别基金资产中计提销售服务费。

认购份额=（认购金额+认购利息）/基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例3：某投资者投资100,000元认购本基金C类基金份额，假定募集期产生的利息为55.00元，则可认购基金份额为：

认购份额=（100,000+55.00）/1.00=100,055.00份

即：该投资者投资100,000元认购本基金C类基金份额，假定募集期产生的利息为55.00元，可得到100,055.00份C类基金份额。

## 十二、投资人对基金份额的认购

### 1、认购时间安排

本基金的认购时间安排、投资人认购时应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

### 2、认购方式

（1）本基金认购采取金额认购的方式。

（2）投资人认购时，须按销售机构规定的方式全额缴款。

### 3、认购确认

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。投资人应在基金合同生效后及时到各销售网点或以销售机构规定的其他方式查询最终成

交确认情况和认购的份额，否则，如因申请未得到登记机构的确认而造成的损失，由投资人自行承担。若投资人的认购申请被确认为无效，销售机构应当将投资人已支付的认购金额本金退还投资人。

#### 4、认购金额的限制

在本基金募集期内，投资人首次认购的最低限额为人民币10元，追加认购单笔最低金额为人民币10元。其中个人投资者通过本基金管理人直销中心首次认购公司旗下基金的最低金额为100万元（含），已有在本基金管理人直销中心认购或申购公司旗下基金记录的个人投资者不受首次认购最低金额100万元

（含）的限制，但受追加认购单笔最低金额的限制。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。投资人在募集期内多次认购的，本基金A类份额的认购费按单笔认购金额对应的费率档次分别计费。认购申请一经销售机构受理，则不可撤销。基金募集期间不设置投资人单个账户最高认购金额限制，但如果以本基金各类份额合计，本基金单个投资人累计认购的基金份额达到或超过本基金总份额50%的，基金管理人有权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某些认购申请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部分认购申请。投资人认购的基金份额以及基金合同生效后登记机构的确认为准。

基金管理人可根据市场情况，调整认购金额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

#### 十三、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。

#### 十四、募集资金的保管

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。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

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。基金管理人应将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。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续20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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，本基金基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在更新的招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

投资者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（若该工作日为非港股通交易日时，则本基金不开放申购和赎回等业务），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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

基金合同生效后，若出现新的证券、期货交易市场、证券、期货交易所交易时间变更、其他特殊情况或根据业务需要，基金管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

### 三、 申购与赎回的原则

#### 1、 “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金



份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待；

6、本基金的申购、赎回等业务，按照登记机构的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会或登记机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，否则所提交的申购申请不成立。投资者交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，必须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。基金份额持有人在规定的时间内递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者 T 日赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后划往投资者银行账户。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购

或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资者。

销售机构对申购、赎回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申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请及申购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人在不违反法律法规的前提下，可对上述程序规则进行调整。基金管理人应在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 五、申购与赎回的数量限制

1、投资人首次申购最低金额为人民币1元，追加申购单笔最低金额为人民币1元；其中个人投资者通过本基金管理人直销中心首次申购公司旗下基金的最低金额为100万元（含），已有在基金管理人直销中心认购或申购公司旗下基金记录的个人投资者不受首次申购最低金额100万元（含）的限制，但受追加申购单笔最低金额人民币1元的限制。

2、基金投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

3、基金投资者可多次申购，对单个基金投资者累计持有基金份额数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

4、基金投资者可将其全部或部分基金份额赎回，单笔最低赎回份额为1份（除非该账户在销售机构或网点托管的基金份额余额不足1份）；若某笔赎回或转换导致基金份额持有人在销售机构或网点托管的基金份额余额少于1份，剩余部分基金份额必须一起赎回，即交易账户最低基金份额为1份。

5、基金管理人有权规定本基金的总规模限额，以及单日申购金额上限和净申购比例上限，具体规定请参见相关公告。

6、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，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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

7、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 七、申购份额与净赎回金额的计算

### （一）申购费用

投资人申购本基金 A 类基金份额时，需缴纳申购费用。投资人在一天内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金 C 类基金份额不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。各销售机构销售的份额类别以其业务规定为准，敬请投资者留意。

A类基金份额的申购费用由A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

本基金对通过直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老保险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，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、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，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表：

（单位：元）

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	0.60%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%
M ≥ 500 万元	每笔1000元

其他投资者申购本基金A类基金份额申购费率见下表：（单位：元）

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.00%
M ≥ 500 万元	每笔1000元

### （二）赎回费用

本基金的赎回费用按基金份额持有人持有时间的增加而递减。赎回费用由

赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。具体费率如下：

A类基金份额	
持有时间（Y）	赎回费率
Y<7 日	1.5%
7 日≤Y<30 日	0.75%
30 日≤Y<365 日	0.5%
Y≥365 日	0
C类基金份额	
持有时间（Y）	赎回费率
Y<7 日	1.5%
7 日≤Y<30 日	0.5%
Y≥30 日	0

持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日（含）但少于90日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期不少于90日（含）但少于180日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产。对于持有期不少于180日（含）的基金份额所收取的赎回费，赎回费用25%归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

### （三）申购份额的计算

#### 1、投资者申购本基金A类基金份额的计算方式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。计算公式如下：

申购费用适用比例费率时：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日A类基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日A类基金份额净值}$$

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的损失

由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

举例：假定T日A类基金份额净值为1.0500元，某非养老金客户当日申购本基金A类基金份额10万元，对应的本次申购费率为1.50%，该投资人的申购费用及可获得的A类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.50\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0500 = 93,830.64 \text{ 份}$$

即：该非养老金客户投资10万元申购本基金A类基金份额，假定申购当日A类基金份额净值为1.0500元，申购费用为1,477.83元，可获得的A类基金份额为93,830.64份。

## 2、投资者申购本基金C类基金份额的计算方式

申购份额 = 申购金额 / 申购日 C 类基金份额的基金份额净值

举例：某投资者投资 40,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额为 1.0400 元，则其可得到的 C 类基金份额为：

$$\text{申购份额} = 40,000 / 1.0400 = 38,461.54 \text{ 份}$$

即：该投资者投资 40,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0400 元，可得到 38,461.54 份 C 类基金份额。

### （四）赎回金额的计算

本基金A类基金份额赎回金额的计算公式如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T日A类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

本基金C类基金份额赎回金额的计算公式如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T日C类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

举例：假定某投资人在T日赎回10,000份A类基金份额，持有时间为250日，对应的赎回费率为0.5%，该日A类基金份额净值为1.2800元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.2800 = 12,800.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,800.00 \times 0.5\% = 64.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 12,800.00 - 64.00 = 12,736.00 \text{ 元}$$

即：假定某投资人在T日赎回10,000份A类基金份额，持有时间为250日，假

定该日A类基金份额净值为1.2800元，则其获得的赎回金额为12,736.00元。

举例：假定某投资人在T日赎回10,000份C类基金份额，持有时间为10日，对应的赎回费率为0.5%，该日C类基金份额净值为1.2800元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000×1.2800=12,800.00元

赎回费用=12,800.00×0.5%=64.00元

赎回金额=12,800.00-64.00=12,736.00元

即：假定某投资人在T日赎回10,000份C类基金份额，持有时间为10日，假定该日C类基金份额净值为1.2800元，则其获得的赎回金额为12,736.00元。

#### （五）基金份额净值的计算

计算日该类基金份额净值=计算日该类基金资产净值/计算日该类基金总额

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

本基金两类基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并根据《基金合同》的约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

如按照上述保留位数的份额净值对投资者的申购或赎回进行确认可能引起基金份额净值剧烈波动的，为维护基金份额持有人利益，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以临时增加基金份额净值的保留位数并以此进行确认，并在确认完成后予以恢复，具体保留位数以届时公告为准。

（六）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对投资者开展不同的费率优惠活动。

当本基金发生大额申购或赎回情形时，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，具体处理原则与操作规范，遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### 八、申购和赎回的登记业务

1、基金投资人当日的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间以内可以撤销。

2、投资人T日申购基金成功后，登记机构在T+1日为投资人增加权益并办

理登记手续，投资人自T+2日起可以查询申请的确认情况。

3、投资人T日赎回基金成功后，登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运转。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，或基金参与港股通交易且港股通暂停交易，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法办理申购业务。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

7、基金管理人、登记机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

8、基金管理人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。

9、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的单日申购金额或净申购比例上限时；或该投资者累计持有的份额超过单个投资者累计持有的份额上限时；或该投资者单日申购金额超过单个投资者单日申购金额上限时；或该投资者单笔申购金额超过单个投资者单笔申购金额上限时。

10、港股通交易每日额度不足，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、10、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上述第8、9项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资者的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货交易所、银行间债券交易市场或外汇市场交易时间非正常停市，港股通暂停交易，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害基金份额持有人利益时，或是发生其他继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、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赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应报中国证监会备案。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

（一）巨额赎回的认定

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。

## （二）巨额赎回的处理方式

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或部分延期赎回。

1、全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

4、暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

## （三）巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并且基金管理人依据“2、部分延期赎回”进行延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的

有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

### 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

### 十四、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### 十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### 十六、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

### 十七、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

### 十八、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以

及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

#### 十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在控制风险的前提下，通过自下而上的选股方式挖掘市场上具有成长空间的公司，力争实现基金资产的长期增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、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它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%（投资于境内依法发行上市的股票、港股通标的股票合计不低于非现金基金资产的 80%，投资于境内依法发行上市的股票不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票不低于非现金基金资产的 20%且不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、投资策略

#### （一）大类资产配置策略

资本市场是经济的晴雨表，本基金综合分析宏观经济环境、政策形势、市场情绪等因素，判断经济周期与趋势，并据此主动判断市场方向，进行相应资产配置。本基金将在宏观经济衰退末期、复苏和繁荣周期阶段，积极增加权益类资产

投资比例；在宏观经济衰退阶段，主动降低权益类资产投资比例，降低组合的风险暴露度，稳健运作。

## （二）股票投资策略

### 1、A 股投资策略

本基金通过持续跟踪优质上市公司的基本面，精选具备良好发展趋势和成长潜力的股票，作为重点进行投资。

#### （1）个股投资策略

本基金将通过定量与定性相结合的分析方法筛选优质公司。

定量研究方面，本基金基于公司定期报告的财务数据指标，分析公司的基本面价值，初步筛选出财务和资产状况良好、盈利能力较强、成长性良好、估值水平合理的优质公司，具体的考察指标主要包括：

1) 成长性指标：营业利润增长率、净利润增长率、收入增长率、现金流量增长率等；

2) 财务指标：产权比率、经营杠杆、毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、流动比率、速动比率、平均存货周转率、平均收账期、利息保障倍数、自由现金流等；

3) 估值指标：市盈率(PE)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市净率法(P/B)、市销率(PS)、企业价值倍数法(EV/EBITDA)等。

定性研究方面，基金管理人将结合研究团队的案头研究、实地调研等研究方法，对企业的产品及服务、竞争优势、公司治理、商业模式、创新能力等因素的分析，选择产品和服务具备市场空间、商业模式符合发展趋势、未来具备市场前景或成长潜力的企业。

#### （2）行业配置策略

在行业配置层面，本基金通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，在把握宏观经济运行趋势和股票市场行业轮动的基础上，综合考虑行业景气度、行业竞争格局、行业估值水平等因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整股票资产在各行业之间的配置。

##### 1) 行业景气度

本基金将密切关注国家相关产业政策、规划动态，并结合行业数据持续跟踪、上下游产业链深入调研等方法，根据相关行业盈利水平的横向与纵向比较，适时对各行业景气度周期与行业未来盈利趋势进行研判，重点投资于景气度较高且具有可持续性的行业。

#### 2) 行业持续成长性

根据国内产业升级进程，结合对海外同类行业发展经验的研究，重点投资未来具备较大市场空间、增长较快、持续成长性较好的行业。

#### 3) 行业竞争格局

本基金主要通过密切跟踪行业进入者的数量、行业内各公司的竞争策略及各公司产品或服务的市场份额来判断公司所处行业竞争格局的变化，重点投资于行业竞争格局良好的行业。

#### 4) 行业估值水平

行业估值水平影响各行业的相对表现。本基金将根据各行业的特点，选择合适的估值方法，重点关注行业平均动态市盈率、行业平均市净率等指标。通过对各行业估值水平的动态分析，选择估值合理的行业进行配置。

### 2、港股投资策略

本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用“自下而上”个股研究方式，精选出具有投资价值的优质标的。其筛选维度主要包括但不限于：治理结构与管理层（例如：良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层等）、行业集中度及行业地位（例如：具备独特的核心竞争优势，如产品优势、成本优势、技术优势和定价能力等）、公司业绩表现（例如：业绩稳定并持续、具备中长期持续增长的能力等）。

本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外，还需关注：（1）香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；（2）人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。

#### （三）债券投资策略

基金管理人通过评估货币政策、财政政策和国际环境等因素，分析市场价格

中隐含的对经济增长、通货膨胀、违约概率、提前偿付速度等因素的预测，根据债券市场中存在的各种投资机会的相对投资价值和相关风险决定总体的投资策略及类属（政府、企业/公司、可转换债券等）和期限（短期、中期和长期）等部分的投资比例，并基于价值分析精选投资品种构建债券投资组合。

本基金采用的主要债券投资策略包括：利率预期策略、收益率曲线策略、信用利差策略、公司/企业债券策略、可转换债券策略等。

#### （四）存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。

#### （五）其他金融工具投资策略

##### 1、可转债投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资。

分离交易可转换债券，是认股权证和公司债券的组合产品，该产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。本基金因认购分离交易可转换债券所获得的认股权证可择机卖出，分离交易可转换债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

##### 2、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的发行条款、基础资产的构成及质量等基本面研究，结合相关定价模型评估其内在价值，谨慎参与资产支持证券投资。

##### 3、国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

##### 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市

场风险。因此股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以获取相应股票组合的超额收益。

#### 四、投资决策程序

##### 1、投资决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- 2) 国内外宏观经济发展状况、微观经济运行环境和证券市场发展趋势；
- 3) 投资品种的预期收益率和风险水平。

##### 2、投资决策程序

###### (1) 投资研究

本基金管理人研究团队充分利用外部和内部的研究资源提供研究成果，挖掘投资机会，为投资决策委员会和基金经理提供决策支持。

###### (2) 投资决策

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，负责制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略，并对基金经理进行授权，对基金的投资进行总体监控。如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决议。

###### (3) 组合构建

基金经理根据投资委员会确定的总体投资策略和原则以及研究团队提供的分析和建议等信息，在遵守基金合同的前提下，在投资决策委员会的授权范围内构建具体的投资组合，进行组合的日常管理。

###### (4) 交易执行

本基金实行集中交易制度。交易团队负责执行基金经理投资指令，同时承担一线风险监控职责。

###### (5) 风险与绩效评估

投资风险管理团队由风险管理部和监察稽核部组成。风险管理部定期或不定期地对基金投资绩效及风险进行评估；监察稽核部对基金投资的合规性进行日常监控；风险管理委员会定期召开会议，结合市场、法律等环境的变化，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施及意见。

###### (6) 组合调整

基金经理根据行业状况、证券市场和上市公司的发展变化、基金申购和赎回



的现金流量情况以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行动态调整。

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并在更新的招募说明书中公告。

## 五、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于境内依法发行上市的股票、港股通标的股票合计不低于非现金基金资产的 80%，投资于境内依法发行上市的股票不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票不低于非现金基金资产的 20%且不超过股票资产的 50%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（7）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 60%-95%；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

7) 在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的

债券总市值的 30%；

8) 在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

9) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(16) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(17) 基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）项、第（6）项、第（7）项、第（12）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

3、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

## 六、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×40% + 恒生指数收益率×40% + 人民币活期存款利率（税后）×20%

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。

如果今后法律法规发生变化，或者市场推出更具权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准，又或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准，而无需召开基金份额持有人大会审议，并及时公告并报中国证监会备案。

## 七、风险收益特征

本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，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、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市

场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

#### 八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 九、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 四、估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票等），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；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

②交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

④交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

⑤交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

⑥对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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；

②首次公开发行未上市的股票、债券，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；

③在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

（4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（5）持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按相应利率逐日计提利



息。

(6) 股指期货、国债期货合约以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，采用最近交易日结算价估值。

(7) 本基金投资存托凭证的估值核算，按照境内上市交易的股票执行。

(8) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。

(9) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(10) 当发生大额申购或赎回情形时，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。

(11) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家法律法规另有规定的，从其规定。基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。基金合同的当事人应按照以下约

定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行

更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）任一类基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）任一类基金份额净值估值错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

七、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、中国证监会和《基金合同》认定的其它情形。

八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第（9）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券、期货交易场所、登记结算机构或存款银行等第三方机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披

露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规和监管部门规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在按照监管部门要求履行适当程序后，经与基金托管人协商一致调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票而产生的各项费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，在月初5个工作日内、按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，在月初5个工作日内、按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值的0.40%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

基金销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

### 五、基金税收



本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资

者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

## （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值；

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值；

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、本基金出现连续 30、40、45 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形时；
- 24、调整基金份额类别的设置；
- 25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）投资股指期货的信息披露

若本基金投资股指期货，基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十一）投资国债期货的信息披露

若本基金投资国债期货，基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十二）投资资产支持证券的信息披露

若本基金投资资产支持证券，基金管理人应在年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十三）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （十四）参与港股通交易的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

#### （十五）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。

#### （十六）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并

保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生基金暂停估值的情形；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。



## 第十六部分 风险揭示

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，投资人购买基金，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。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型的基金，投资人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，投资人承担的风险也越大。

投资人应当认真阅读《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件，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人的风险承受能力相适应。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，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，由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金销售机构名单详见发售公告及相关公告。

本基金为混合型基金，理论上其长期平均预期风险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。

本基金在认购期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

### 一、投资于本基金面临的主要风险

基金风险表现为基金收益的波动，基金管理过程中任何影响基金收益的因

素都是基金风险的来源。基金的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、政策变更风险、税收风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险。

#### 1、市场风险

本基金为混合型证券投资基金，证券市场的变化将影响基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与证券发行人的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

##### （1）经济周期风险

随着宏观、微观经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平及证券市场也将呈现周期性变化。本基金投资于股票、债券等金融工具的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### （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、地区发展政策等）发生变化，导致证券市场价格波动而产生风险。

##### （3）上市公司经营风险

本基金所投资的上市公司可能会因为经营不善，基本面状况恶化而导致其股票价格下跌，使得基金投资收益下降。此外，股票价格也会受到市场整体估值水平的影响，并可能会低于上市公司的合理价值。虽然本基金可通过分散化投资减少非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。本基金还必须承担市场的系统性风险。

##### （4）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券，其收益水平可能会受到利率变化的影响而产生波动。

##### （5）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者证券发行人经营不善，信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

##### （6）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的实际收益率。

##### （7）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券收回本息后以及回购到期后再投资收益的影响。当市场利率下降时，基金收回固定收益证券本息以及回购到

期后进行再投资时，面临获得的收益率低于原来利率的风险。

#### （8）市场供需风险

如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化，证券市场参与主体可用资金数量和证券市场可供投资的证券数量可能发生相应的变化，最终影响证券市场的供需关系，造成基金投资收益的变化。

#### （9）债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

#### （10）利差风险

债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

#### （11）债券回购风险

债券回购为提升基金整体投资收益提供了可能，但也存在一定的风险。在进行回购操作时，可能存在回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，同时对投资组合的波动性进行了放大，致使整个组合风险放大的风险。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

### 2、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

### 3、流动性风险

流动性风险指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险；或是为应对投资者赎回，变现冲击成本较高，给基金资产造成损失的风险。

本基金的流动性风险一方面来自于投资人的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合或其中的部分资产变现能力变弱所产生的风险。主要包括：

（1）巨额赎回风险：本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，可能会发生巨额赎回的情形。当本基金发生单一投资者持有基金份额占比较大的情形时，若上述投资者集中大额赎回本基金，亦可能引发巨额赎回的情形。投资者可能面临以下风险：

A. 由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点

导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。

B. 当基金发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定部分延期办理赎回或暂停接受基金的赎回申请或延缓支付赎回款，投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。若本基金发生巨额赎回且发生单一投资者的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%的，基金管理人有权采取具体措施对其进行延期办理赎回申请，该投资者可能面临当日的部分赎回申请被延期办理的风险。

（2）变现风险：投资组合的变现能力较弱所导致基金收益变动的风险。当本基金持有的部分证券品种交投不活跃、成交量不足或是处于跌停板时，资产变现的难度可能会加大，若存在证券停牌的情形，资产可能难以在短时间内迅速变现。或者，由于基金持有的某种资产集中度过高，导致难以在短时间内迅速变现，有可能导致基金的净值出现损失。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，其中股票及存托凭证投资占基金资产的比例为60-95%，主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。股票流动性较好，存在部分股票品种停牌或交投不活跃的情况；大部分债券品种流动性较好，存在部分债券品种停牌或是企业债、资产证券化、回购等品种流动性相对较差的情况。综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。但如果市场短时间内发生较大变化或基金赎回量较大，可能会影响到基金的流动性和投资收益。

本基金由基金管理人作为交易参与者通过交易单元在证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、证券登记机构可以采取限制交易单元交易权限等处理措施，本基金可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，进而可能会影响到基金的流动性，亦有可能导致基金的净值出现损失。

（3）启用侧袋机制的风险：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。实施侧袋机制期间，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。因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。

为了控制流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个券原则的基础上，通过一系列风险控制措施加强对流动性风险的跟踪、防范和控制。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) 延期办理巨额赎回申请

具体措施，详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“十一、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

具体措施，详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

3) 暂停基金估值

当本基金发生特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上等暂停基金估值的情形时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施，投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额或如期进行基金投资的风险。

4) 摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时，根据基金合同的约定，基金管理人可采用摆动定价机制，以确定基金估值的公平性，可能会加大基金份额净值的波动，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动，从而影响投资者的申购和赎回价格。

5) 启用侧袋机制

侧袋机制属于流动性风险管理工具。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，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，基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项，但因特定资产的变现时间以及最终变现价格均具有不确定性，并且变现价格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。

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考虑主袋账户资产，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的价值及

变化情况。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。

当本基金出现上述1)、2)、3)情形时，本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请，投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

#### 4、操作风险

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、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 5、合规性风险

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。

#### 6、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的的风险，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

#### 7、税收风险

在本基金存续期间，税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适用的税率等进行调整。届时，基金管理人将执行更新后的政策，可能会因此导致基金资产实际承担的税费发生变化。该等情况下，基金管理人有权根据法律法规及税收政策的变化相应调整税收处理，该等调整可能会影响到基金投资者的收益，也可能导致基金财产的估值调整。由于前述税收政策变化导致对基金资产的收益影响，将由持有该基金的基金投资者承担。对于现有税收政策未明确事项，本基金主要参照行业协会建议方案进行处理，可能会与税收征管认定存在差异，从而产生税费补缴及滞纳金，该等税费及滞纳金将由基金财产承担。

## 8、本基金特有的风险

(1) 本基金为偏股混合型基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或基金管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为60%-95%，属于股票仓位偏高且相对稳定的基金品种，受股票市场系统性风险影响较大，如果股票市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响，投资者面临无法获得收益甚至可能发生较大亏损的风险。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金无法完全规避股票市场和债券市场的下跌风险。

(2) 本基金投资于港股通标的股票主要面临的风险包括但不限于：

### 1) 投资于香港证券市场的特有风险

A. 香港证券市场与内地证券市场规则差异的风险。香港证券市场与内地证券市场存在诸多差异，本基金参与港股通交易需遵守内地与香港相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和业务规则，对香港证券市场有所了解；通过港股通参与香港证券市场交易与通过其他方式参与香港证券市场交易，也存在一定的差异。以上情形可能增加本基金的投资风险。

B. 股价较大波动的风险。港股通标的股票可能出现因公司基本面变化、第三方研究分析报告的观点、异常交易情形、做空机制等原因而引起股价较大波动的情形。此外，港股市场实行 T+0 回转交易机制，且个股涨跌幅不设限制，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更为剧烈的股价波动，由此增加本基金净值的波动风险。

C. 中小市值公司投资风险。中小市值公司存在业绩不稳定、股价波动性较大、市场流动性较差等风险，若本基金投资中小市值股票，本基金的投资风险可能增加。

D. 股份数量、股票面值大幅变化的风险。部分港股上市公司基本面变化大，股票价格低，可能存在大比例折价供股或配股、频繁分拆合并股份的行为，投资者持有的股份数量、股票面值可能发生大幅变化，由此可能增加本基金的投资风险。

E. 停牌风险。与内地证券市场相比，香港联合交易所市场股票停牌制度存在一定差异，港股通标的股票可能出现长时间停牌现象，由此可能增加本基金的投资风险。

F. 直接退市风险。与内地证券市场相比，香港联合交易所市场股票交易没有退市风险警示、退市整理等安排，相关股票存在直接退市的风险。港股股票一旦退市，本基金将面临无法继续通过港股通买卖相关股票的风险。此外，港股通标

的股票退市后，中国证券登记结算有限责任公司通过香港中央结算有限公司继续为投资者提供的退市股票名义持有人服务可能会受限。以上情况可能增加本基金的投资风险。

G. 交收制度带来的风险。香港证券市场与内地证券市场在证券资金的交收期安排上存在差异，香港证券市场的交收期为T+2日，卖出资金回到本基金人民币账户的周期比内地证券市场要长，此外港股的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交易。因此，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而带来流动性风险。

H. 投票权不同带来的风险。部分港股通上市公司存在不同投票权安排，公司可能因存在控制权相对集中，或因某特定类别股份拥有的投票权利大于或优于普通股份拥有的投票权利等情形，而使普通投资者的投票权利及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。

I. 生物科技公司投资风险。部分港股通生物科技公司可能存在公开发行并上市时尚未有收入，上市后仍无收入、持续亏损、无法进行利润分配等情形，由此可能增加本基金的投资风险。

## 2) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的特有风险

A. 港股通规则变动带来的风险。本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

B. 港股通标的股票范围受限及动态调整的风险。本基金可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通标的股票名单会动态调整。对于被调出的港股通标的股票，自调整之日起，本基金将不得再行买入。以上情形可能对本基金带来不利影响。

C. 基金净值波动风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，只有内地和香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，存在港股通交易日不连贯的情形，而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

D. 交易失败及交易中断的风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，港股通交易存在每日额度限制，本基金可能面临每日额度不足而交易失败的风险。若香港联合交易所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致15分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险。

E. 无法进行交易的风险。香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定



的其他情形时，香港证券市场将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，本基金将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

F. 汇率风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，港股的买卖是以港币报价、而本基金是以人民币计价并支付，港币对人民币汇率的波动，将会影响本基金以人民币计价的基金资产净值，从而导致基金资产面临潜在风险。同时，由于在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，最终结算汇率为相关机构日终确定的数值，若因汇率大幅波动等原因，可能会导致本基金的账户透支风险。因此，本基金面临汇率波动的不确定性风险，从而可能增加本基金的投资风险。

G. 交易价格受限的风险。港股通标的股票不设置涨跌幅限制，但根据香港联合交易所业务规则，适用市场波动调节机制的港股通标的股票的买卖申报可能受到价格限制。此外，对于适用收市竞价交易的港股通标的股票，收市竞价交易时段的买卖申报也将受到价格限制。以上情形可能增加本基金的投资风险。

H. 港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。本基金因所持香港证券市场股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通标的股票以外的香港联合交易所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通标的股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通标的股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

I. 结算风险。香港结算机构可能因极端情况存在无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：因结算参与人未完成与中国证券登记结算有限责任公司的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；结算参与人向中国证券登记结算有限责任公司发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

### 3) 其他风险

A. 每个港股通交易日的交易时间包括开市前时段、持续交易时段和收市竞价交易时段，具体按香港联合交易所的规定执行。圣诞前夕（12月24日）、元旦前夕（12月31日）或除夕日为港股通交易日的，港股通仅有半天交易，且当日为非交收日。若该工作日非港股通交易日，本基金不开放，投资人无法进行申购与

赎回。

B、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形，本基金可能发生拒绝或暂停申购，暂停赎回或延缓支付赎回款的情形，可能影响投资人的申购以及份额持有人的赎回。

(3) 本基金投资股指期货、国债期货的风险。

本基金可投资于股指期货、国债期货，股指期货、国债期货作为金融衍生品，主要存在以下风险：

A、基差风险：股指期货、国债期货的标的指数价格与期货价格之间的价差被称为基差。基差风险是期货市场的特有风险之一，是由于期货与现货间价差的波动，可能影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。

B、保证金管理风险：期货交易采用保证金制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。保证金预留过多会导致资金运用效率过低，减少预期收益。保证金不足将存在被强行平仓的风险，从而导致超出预期的损失，并使得原有的投资策略不能得以实现。

C、杠杆风险：由于期货采用保证金交易而存在杠杆效应，因此放大了基金财产波动幅度。

D、合约品种差异造成的风险：类似的合约品种在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：1) 价格变动的方向相反；2) 价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。

E、流通量风险：是指因市场缺乏广度或深度，可能导致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。

(4) 本基金投资于资产支持证券的风险。

本基金投资范围包括资产支持证券，尽管基金管理人本着谨慎和控制风险的原则进行投资，但仍面临以下风险：

A、信用风险：若本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，可能造成基金财产损失。

B、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。

C、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。

D、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。

E、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。

(5) 本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与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。

(6) 本基金投资于流通受限证券的风险。

本基金可投资流通受限证券，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，本基金的基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有证券的收盘价所对应的净值，因此，投资者在申购赎回时，需考虑估值方法对基金净值的影响。另外，本基金可能由于投资流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

(7) 本基金聘请境外投资顾问的风险

本基金将聘请符合要求的香港机构担任港股投资顾问，但在选择投资顾问时采用的标准以及掌握的信息有一定的时效性及局限性。在本基金运作过程中，港股投资顾问的投资研究水平、服务能力直接影响本基金收益水平。在本基金投资管理运作过程中，如果港股投资顾问对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全都会影响本基金的收益水平。基金管理人在参考港股投资顾问所出具的投资建议时，可能存在由于对投资顾问信息掌握不及时、不全面而导致未能及时发现投资顾问的投资建议存在不适当之处，同样可能造成本基金的亏损。

(8) 《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，则基金合同终止，不需要召开基金份额持有人大会。因此，基金份额持有人将可能面临基金合同自动终止的风险。

## 9、法律风险

由于交易合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给交易者带来损失的可能性。法律风险主要发生在O T C（也称为柜台市场）的交易中，主要来自两个方面：一是合约的不可实施性，包括合约潜在的非法性，对手缺乏进行该项交易的合法资格，以及现行的法律法规发生变更而使该合约失去法律效力等；二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行平仓交易。

#### 10、其他风险

- （1）因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- （2）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- （3）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- （4）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- （5）因业务竞争压力可能产生的风险；
- （6）战争、自然灾害等不可抗力导致基金资产遭受损失产生的风险，以及由此致使基金的申购和赎回不能按正常时限完成而产生的风险；
- （7）其他风险。

#### 二、声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

3、本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准、将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。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。

## 第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制或其他原因，导致基金财产不能及时变现的，清算期限可以相应顺延。

#### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 第十八部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户份额。

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### （一）基金份额的申购与赎回

##### 1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

##### 2、主袋账户

启用侧袋机制当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

#### （二）基金的投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操



作。

### （三）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

### （四）基金的费用

本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费和销售服务费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。

基金管理人可以将与侧袋账户有关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免。

### （五）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

### （六）基金的信息披露

#### 1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间，本基金暂停披露侧袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 2、定期报告

基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，若披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺。

#### 3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

### （七）侧袋账户中特定资产处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方

式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

#### （八）侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十九部分 基金合同内容摘要

以下内容摘自《摩根士丹利华鑫沪港深精选混合型证券投资基金基金合同》

### （一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东和债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
- （17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集资金，办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会

并通知基金托管人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、

合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费、调整收费方式或增加新的基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售、取消某基金份额类



别、对基金份额分类办法及规则进行调整；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 基金管理人、基金登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(6) 基金推出新业务或服务；

(7) 履行适当程序后，变更业绩比较基准；

(8) 调整基金收益的分配原则和支付方式；

(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3、自基金合同生效日起，出现如下情形之一的，本基金基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 连续 50 个工作日，基金资产净值低于 5000 万元；

(2) 连续 50 个工作日，基金份额持有人数量少于 200 人。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份

额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开

会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

###### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以

特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内

容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制或其他原因，导致基金财产不能及时变现的，清算期限可以相应顺延。

#### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同



有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人及基金托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十部分 基金托管协议内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

邮政编码：518048

法定代表人：王鸿嫔

成立日期：2003年3月14日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]33号

组织形式：有限责任公司

注册资本：25,000 万元人民币

存续期间：永续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

组织形式：股份有限公司

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；

外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、投资比例等进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、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它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%（投资于境内依法发行上市的股票、港股通标的股票合计不低于非现金基金资产的 80%，投资于境内依法发行上市的股票不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票不低于非现金基金资产的 20%且不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于境内依法发行上市的股票、港股通标的股票合计不低于非现金基金资产的 80%，投资于境内依法发行上市的股票不低于非现金基金资产的 20%，投资于港股通标的股票不低于非现金基金资产的 20%且不超过股票资产的 50%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

（5）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（7）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 60%-95%；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

7) 在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

8) 在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

9) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(16) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(17) 基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）项、第（6）项、第（7）项、第（12）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，基金合同约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第十一项基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实

性、完整性、全面性。基金管理人责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人应及时确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人有权向中国证监会报告。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金净值信息计算、各类基金份额申购赎回价格、应收资金到账、基金费用开支及收入确

定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4. 在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

6. 基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基



金管理人承担。

7. 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行基金托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

（九）基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人应基金托管人的业务核查

（一）基金管理人应基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金净值信息、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核

对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事

务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

3、基金托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### （四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与

结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、基金管理人根据投资需要按照规定开立期货保证金账户及期货交易编码等，基金托管人按照规定开立投资所需账户。完成上述账户开立后，基金管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和市场监控中心的登录用户名及密码告知基金托管人。资金密码和市场监控中心登录密码重置由基金管理人进行，重置后务必及时通知基金托管人。

基金托管人和基金管理人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。基金管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给基金托管人。因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

### 五、基金资产净值计算和会计复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量后得到的基金份额的资产净值。各类基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

## 2、复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

## 3、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 六、基金份额持有人名册的保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

## （二）基金托管协议终止的情形

1. 《基金合同》终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金托管业务；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理业务；
4. 发生法律法规、中国证监会或《基金合同》规定的终止事项。

## （三）基金财产的清算

### 1. 基金财产清算小组

（1）自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（4）基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 2. 基金财产清算程序

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制或其他原因，导致基金财产不能及时变现的，清算期限可以相应顺延。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4. 基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）网上交易服务

个人投资人除通过基金管理人的直销网点和销售机构的销售网点办理申购、赎回、信息查询等业务外，还可通过基金管理人网站（[www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)）享受网上交易服务。具体业务规则详见基金管理人网站。

### （二）网上查询服务

个人投资人除通过基金管理人的销售机构的销售网点查询基金持有情况之外，还可通过基金账号或者身份证号码和查询密码登陆基金管理人网站（[www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)）“账户查询”栏目，可享有账户查询、对账单查询、信息定制、资料修改等多项在线服务。

### （三）服务产品的定制及发送

投资人可根据个人需要，通过基金管理人客服电话、网站、电子邮件、短信等方式订阅或取消对账单服务及免费定制信息。投资人还可通过发送邮件、短信进行业务咨询。

1、对账单服务：基金管理人将按照投资人需求，提供月度电子邮件账单或月度短信账单。投资人可通过拨打基金管理人客服电话、登录基金管理人网站、发送电子邮件或短信等方式向基金管理人主动定制月度短信账单。对于未订阅账单服务、且有手机号码的投资人，基金管理人将默认提供年度短信账单。对于未订阅账单服务、且有邮件联系方式的投资人，基金管理人将默认提供月度电子邮件账单。

若投资人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打基金管理人客服热线400-8888-668（免长途话费）按“9”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、持有基金名称、购买销售机构、购买金额等，客服人员核对信息无误后，将通过平信方式为投资人免费邮寄纸质对账单。

对账单服务发送规则如下：如投资人成功定制电子邮件账单或短信账单，基金管理人将在每月初5个工作日内发送。

2、免费定制信息：投资人可定制的信息包括：基金份额净值、基金视窗等信息。基金管理人可通过邮件或短信方式向投资人发送所定制的信息。

### （四）在线客服服务

投资人可登录基金管理人网站（[www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)）通过“在线客服”



进行业务咨询或留言。在线客服提供基金产品信息查询、基金业务咨询、服务投诉和建议等服务。

在线客服服务时间为周一至周五上午9:00-11:00, 下午13:00-17:00 (节假日除外)。

#### (五) 客户服务中心电话服务

客户服务中心自动语音系统提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工座席提供每周五天, 每天不少于7小时的座席服务, 投资人可通过该电话查询认购、申购和赎回等交易情况、基金账户余额、信息定制、资料修改、服务投诉及获得其他业务咨询等专项服务。

#### (六) 客户投诉处理

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务中心电话或以书信、传真、电子邮件等方式, 对基金管理人所提供的服务提出建议或投诉(具体渠道见以下服务联系方式)。

对于工作日受理的投诉, 原则上当日回复, 不能当日回复的, 在3个工作日内回复。对于非工作日受理的投诉, 原则上在顺延的第一个工作日回复, 不能及时回复的, 在3个工作日内回复。

#### (七) 服务联系方式

基金管理人网址: [www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)

客服电子信箱: [services@msfnfunds.com.cn](mailto:services@msfnfunds.com.cn)

全国统一客服电话: 400-8888-668 (免长途费)

传真: (0755) 82990631

信件邮寄地址: 深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层摩根士丹利华鑫基金客户服务中心

邮编: 518048

(八) 如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容, 请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前, 您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十二部分 其他应披露事项

暂无。

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人和销售机构的住所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.msfnfunds.com.cn](http://www.msfnfunds.com.cn)）查阅和下载招募说明书。

## 第二十四部分 备查文件

- （一）中国证监会准予本基金注册募集的文件；
- （二）本基金基金合同；
- （三）本基金托管协议；
- （四）法律意见书；
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （七）中国证监会要求的其他文件。

上述文件存放在基金管理人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅。

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

2021年11月5日