

汇添富社会责任混合型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2022年3月9日更新)

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2010 年 12 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1887 号文核准募集。本基金基金合同于 2011 年 3 月 29 日正式生效。

根据基金管理人 2015 年 8 月 5 日刊登的《汇添富基金管理股份有限公司关于变更旗下部分“股票型证券投资基金”的基金名称并相应修订基金合同部分条款的公告》，汇添富社会责任股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 5 日起更名为汇添富社会责任混合型证券投资基金。

经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人于 2022 年 3 月 7 日发布公告《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增设基金份额并修改法律文件的公告》，决定自 2022 年 3 月 7 日起本基金增设 C 类和 D 类基金份额，原份额变更为 A 类基金份额。

基金管理人保证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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，并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，由于基金投资者连续大量赎回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，本基金的特定风险，等等。本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述

是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需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。

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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过 50% 的除外。

本基金的投资范围包括存托凭证，除普通股票投资可能面临的宏观经济风险、政策风险、市场风险、流动性风险外，还将面临存托凭证持有人与持有基础股票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、发行人采用协议控制架构的风险、增发基础证券可能导致的存托凭证持有人权益被摊薄的风险、交易机制相关风险、存托凭证退市风险等其他风险。

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。

本次招募说明书更新主要涉及基金经理变更，更新所载内容截止日为 2022 年 3 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 12 月 31 日。

## 目 录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	23
五、相关服务机构.....	26
六、基金的募集.....	28
七、基金合同的生效.....	32
八、基金的申购与赎回.....	33
九、基金的投资.....	46
十、基金的业绩.....	59
十一、基金的财产.....	61
十二、基金资产的估值.....	62
十三、基金的收益分配.....	69
十四、基金的费用与税收.....	71
十五、基金的会计与审计.....	74
十六、基金的信息披露.....	75
十七、风险揭示.....	81
十八、侧袋机制.....	89
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	92
二十、基金合同的内容摘要.....	95
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	111
二十二、对基金份额持有人的服务.....	130
二十三、其他应披露事项.....	132
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	134
二十五、备查文件.....	135

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》”）及其他有关法律法规以及《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金合同》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。

本基金根据本招募说明书所载明的资料申请募集。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本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。基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、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：指汇添富社会责任混合型证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指汇添富基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《汇添富社会责任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、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《汇添富社会责任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：指《汇添富社会责任混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订
- 9、《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，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
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《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《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
- 12、《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

13、《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作出的修订

14 中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

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：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

21、基金投资者：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

22、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

23、基金销售业务：指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指直销机构和代销机构

25、直销机构：指汇添富基金管理股份有限公司

26、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

27、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

28、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等

29、**注册登记机构**：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司或接受汇添富基金管理股份有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

30、**基金账户**：指注册登记机构为基金投资者开立的、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

31、**基金交易账户**：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

32、**基金合同生效日**：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

33、**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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

34、**基金募集期限**：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

35、**存续期**：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、**日**：指公历日

38、**月**：指公历月

39、**T日**：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

40、**T+n日**：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

41、**开放日**：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

42、**交易时间**：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

43、**认购**：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

44、**申购**：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

45、**赎回**：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

46、**基金转换**：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

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变更所持基金份额销售机构的操作



48、巨额赎回：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）超过上一日基金总份额的 10% 的情形

49、元：指人民币元

50、基金收益：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

51、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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

53、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的数值

54、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

55、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以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产，如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对上述流动性受限资产范围进行调整

56、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（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、《业务规则》：指《汇添富基金管理股份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注册登记方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守

58、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

59、基金产品资料概要：指《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

60、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

61、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

62、基金份额类别：指本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等事项的不同，将基金份额分为不同的类别

63、A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额

64、C类、D类基金份额：指从本类别基金财产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额

65、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

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市黄浦区外马路 728 号

法定代表人：李文

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]5 号

注册资本：人民币 132,724,224 元

联系人：李鹏

联系电话：021-28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

李文先生，2015 年 4 月 16 日起担任董事长。中国籍，1967 年出生，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。其他现任职务包括中国证券投资基金业协会副

会长、合规与风险管理专业委员会主席，上海市基金同业公会副会长，深圳证券交易所理事会创业板股票发行规范委员会委员等。

程峰先生，2016年11月20日起担任董事。中国籍，1971年出生，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海东方报业集团董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018年3月21日起担任董事。中国籍，1971年出生，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司董事、总经理、党委副书记，东航国际控股(香港)有限公司董事，汇添富基金管理股份有限公司董事。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理、董事长，东航国际融资租赁有限公司董事、董事长，东航国际金融(香港)有限公司董事，国泰人寿保险有限责任公司董事、副总经理，东航金控有限责任公司党委书记、副总经理等。

张晖先生，2015年4月16日起担任董事，总经理。中国籍，1971年出生，上海财经大学数量经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资总监、投资决策委员会副主席，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

魏尚进(WEI SHANG JIN)先生，2020年1月9日起担任汇添富基金独立董事。美国籍，1964年出生，加州大学伯克利分校经济学博士。现任复旦泛海国际金融学院学术访问学者、美国哥伦比亚大学终身讲席教授、美国外交关系委员会成员、美国国民经济研究局研究员、欧洲经济政策研究中心研究员、深圳高等金

融研究院理事、香港金融管理局金融研究院顾问等。曾于 2014-2016 年间任亚洲开发银行首位华人首席经济学家兼区域合作与经济研究局局长。其它既往职务包括哈佛大学肯尼迪政府学院副教授、美国国民经济研究局中国经济研究组创始主任、美国布鲁金斯学会高级研究员、国际货币基金组织贸易与投资研究主管、世界银行顾问、美国联邦储备系统董事局访问学者等。

黄钰昌 (HWANG YUH-CHANG) 先生, 2021 年 9 月 23 日起担任汇添富基金独立董事。美国籍, 1955 年出生, 加州大学伯克利分校会计学博士。现任中欧国际工商学院会计学终身荣誉教授、卓越服务研究领域主任和 DBA 课程学术主任, 美国亚利桑那大学荣退教授, 教学和研究领域包括管理会计、公司治理、激励合同设计、绩效评估、医疗成本和质量。曾任美国匹兹堡大学凯兹商学院助理教授、美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院会计系终身教授, 曾于 2007-2009 年间被选为美国会计学会的管理会计学会秘书长。

连平先生, 2021 年 9 月 23 日起担任汇添富基金独立董事。中国籍, 1956 年出生, 华东师范大学金融专业博士, 教授, 博士生导师。现任植信投资研究院院长兼首席经济学家、华东师范大学经济与管理学部名誉主任, 国务院金融稳定发展委员会特聘专家、国家发展改革委员会价格监测中心特聘专家、中国首席经济学家论坛理事长、中国银行业协会行业发展研究委员会主任、亚洲金融智库首席经济学家委员会副主任、上海市人民政府决策咨询特聘专家, 上海市经济学会副会长、享受国务院政府特殊津贴。2007-2019 任交通银行首席经济学家。曾多次出席党和国家领导人主持的专家会议。

## 2、监事会成员

毛海东, 2015 年 6 月 30 日起担任监事, 2021 年 9 月 23 日起担任监事会主席。中国籍, 1978 年出生, 经济学硕士。现任东航金控有限责任公司财富管理中心总经理, 东航期货有限责任公司董事长、党总支书记, 东航国际控股(香港)有限公司董事, 东航国际金融(香港)有限公司董事, 东航商业保理有限公司董事, 汇添富基金管理股份有限公司监事。曾任东航金控有限责任公司总经理助理, 曾任职于东航集团财务有限责任公司等。

任瑞良先生, 2004 年 10 月 20 日起担任监事, 2015 年 6 月 30 日至 2021 年 9 月 23 日担任监事会主席。中国籍, 1963 年出生, 大学学历, 会计师、非执业

注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管，文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生，2015年9月8日起担任监事。中国籍，1973年出生，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员，金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

王静女士，2008年2月23日起担任职工监事。中国籍，1977年出生，复旦大学EMBA。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融总部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008年2月23日起担任职工监事。中国籍，1977年出生，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013年8月8日起担任职工监事。中国籍，1979年出生，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

### 3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015年6月25日起担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012年3月7日起担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日起担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理

财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日起担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日起担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席信息官。

李鹏先生，2015年6月25日起担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

#### 4、基金经理

##### （1）现任基金经理

张伟，国籍：中国。学历：北京大学微电子学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016年7月加入汇添富基金担任消费行业研究员、高级研究员。2022年3月7日至今任汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理。

##### （2）历任基金经理

欧阳沁春，2011年3月29日至2019年1月18日任汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理。

雷鸣，2019年1月18日至2020年3月20日任汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理。

谭志强，2020年3月20日至2022年3月7日任汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会

主席：袁建军（副总经理）

成员：王栩（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监，基金经理）、韩贤旺（首席经济学家，国际业务部总监）、宋鹏（养老金投资部总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时足额向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制基金季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、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者实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

### （四）基金管理人和基金经理的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。



2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (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) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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，不从事以下活动：

- (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利益；
- (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；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露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；
- (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) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉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、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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；

(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) 基金管理人的风险管理体系**

本基金管理人将经营管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、营运风险和道德风险四大类，其中，投资风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险等。针对上述各类风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系。

#### **1、风险管理原则**

基金管理人风险管理体系的构建遵循以下六项基本原则：

(1) 营造良好的风险管理文化和内部控制环境，使风险意识贯穿到每位员工、各个岗位和经营管理的各个环节。

(2) 建立完善的风险管理组织体系，切实保证风险管理部门的独立性和权威性，使其有效地发挥职能作用。

(3) 确保风险管理制度的严肃性，保证风险管理制度在投资管理和经营活动过程中得到切实有效的执行。

(4) 运用合理有效的风险指标和模型，实现风险事前配置和预警、事中实时监控、事后评估和反馈的全程嵌入式投资风险管理模式。

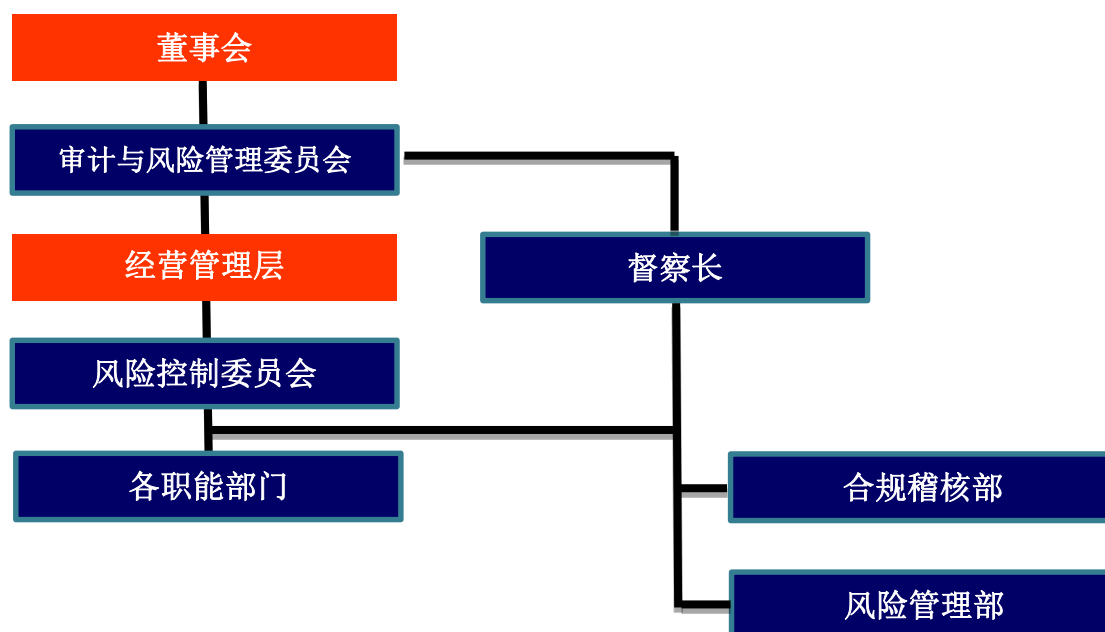
(5) 建立和推进员工职业守则教育和专业培训体系，确保员工具备良好的职业操守和充分的职责胜任能力。

(6) 建立风险事件学习机制，认真剖析各类风险事件，汲取经验和教训，不断完善风险管理体系。

#### **2、风险管理组织架构**

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

### **汇添富风险管理组织结构图**



(1) 董事会对公司风险管理负有最终责任，董事会下设审计与风险管理委员会与督察长。审计与风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策，对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司合规稽核和风险管理工作，监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

(2) 经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

(3) 合规稽核部和风险管理部是合规管理和风险管理的职能部门，负责合规风险、投资组合市场风险、信用风险、流动性风险、营运风险、道德风险等的管理。

(4) 各职能部门负责从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

### 3、风险管理内容

本基金管理人的风险管理包括风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告等内容。

(1) 风险识别是指对现实以及潜在的各种风险加以判断、归类和鉴定风险性质的过程。

(2) 风险测量是指估计和预测风险发生的概率和可能造成的损失，并根据这两个因素的结合来衡量风险大小的程度。

(3) 风险控制是指采取相应的措施，监控和防止各种风险的发生，实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减轻损失。

(4) 风险评价是指分析风险识别、风险测量和风险控制的执行情况和运行效果的过程。

(5) 风险报告是指将风险事件及处置、风险评价情况以一定程序进行报告的过程。

## 六、基金管理人的内部控制制度

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

### 1、内部控制目标

(1) 保证基金管理人经营运作遵守国家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，实现持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金管理人和基金财务及其他信息的真实、准确、及时、完整。

### 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、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制的有效执行。

(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，基金资产、固有财产、其他资产的运作相互分离。

(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、内部控制内容

基金管理人的内部控制要求建立：不相容职务相分离的机制、完善的岗位责任制、规范的岗位管理措施、完整的信息资料保全系统、严格的授权控制、有效的风险防范系统和快速反应机制等。

基金管理人遵守国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制订了系统完善的内部控制制度。内部控制的内容包括投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制以及内部稽核控制等。

#### (1) 投资管理业务控制

基金管理人通过规范投资业务流程，分层次强化投资风险控制。公司根据投资管理业务不同阶段的性质和特点，制定了完善的管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险，分别采取不同措施进行控制。

针对投资研究业务，基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司投资研究部制度》，对研究工作的业务流程、研究报告质量评价，研究与投资的交流渠道等都做了明确的规定；对于投资决策业务，基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》，保证投资决策严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的要求，同时设立了汇添富投资风险评估与管理制以及投资管理业绩评价体系；对于基金交易业务，基金管理人将实行集中交易与防火墙制度，建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施，交易流程将严格按照“审核—执行—反馈—复核—存档”的程序进行，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。

#### (2) 信息披露控制

基金管理人通过完善信息披露制度，确保基金份额持有人及时完整地了解基金信息。基金管理人按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立了《汇添富基金管理股份有限公司公开募集证券投资基金信息披露管理制度》，指定了信息披

露责任人负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布，并将定期对信息披露进行检查和评价，保证公开披露的信息真实、准确、完整。

### （3）信息技术系统控制

基金管理人建立了先进的信息技术系统和完善的信息技术管理制度。基金管理人的信息技术系统由先进的计算机系统构成，通过了国家、金融行业软件工程标准的认证，并有完整的技术资料。基金管理人制定了严格的信息技术岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施，对电子信息数据进行即时保存和备份，重要数据实行异地备份并且长期保存，确保了系统可靠、稳定、安全地运行。在人员控制方面，对信息技术人员进行有关信息系统安全的统一培训和考核；信息技术人员之间定期轮换岗位。

### （4）会计系统控制

基金管理人通过建立严格的会计系统控制措施，确保会计核算正常运转。基金管理人根据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册。通过事前防范、事中检查、事后监督的方式发现、堵截、杜绝基金会计核算中存在的各种风险。具体措施包括：采用了目前最先进的基金核算软件；基金会计严格执行复核制度；基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式；每日制作基金会计核算估值系统电子数据的备份，同时打印保存书面的记账凭证、各类会计报表、统计报表，并由专人保存原始记账凭证等。

### （5）内部稽核控制

基金管理人通过制定稽核监察制度，开展独立监督，确保内部控制的有效性。基金管理人设立督察长，督察长可以列席基金管理人召开的任何会议，调阅相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。公司为合规稽核部配备充足合格的稽核监察人员，监督各业务部门和人员遵守法律、法规和规章的有关情况；检查各业务部门和人员执行内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## 4、基金管理人关于内部控制制度声明书

### （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、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：贺倩

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。

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、市场营销部、内控监管部、账户管理部, 拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、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。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2020 年 12 月 31 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 578 只。

### (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、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。

#### 2、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。

### 3、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：

- 1、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；
- 2、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；
- 3、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。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

（1）汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

邮箱：guitai@htffund.com

网址：www.99fund.com

（2）汇添富基金管理股份有限公司线上直销系统

#### 2、代销机构

本基金的其他销售机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

### （二）注册登记机构

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932888

传真：（021）28932876

联系人：韩从慧

### （三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：黎明、陈颖华

联系人：陈颖华

#### （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：许培菁

经办会计师：许培菁、韩云

## 六、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》等有关法律法规以及基金合同的规定，经 2010 年 12 月 23 日中国证监会证监许可【2010】1887 号文件核准募集。

### （一）基金的类型及存续期间

- 1、基金类型：混合型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、存续期间：不定期

### （二）募集方式

基金募集期内，本基金通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见发售公告）公开发售。

### （三）募集期限

自基金份额发售之日起，最长不得超过 3 个月，具体发售时间见发售公告。

### （四）募集对象

中国境内的个人投资者和机构投资者、合格境外机构投资者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。

### （五）募集场所

本基金将通过基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点公开发售。投资者还可以登录基金管理人网站（[www.99fund.com](http://www.99fund.com)）办理开户、认购等业务，网上交易开通流程、业务规则请登录基金管理人网站查询。

募集期间，基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。

具体销售城市（或网点）名单和联系方式，请参见本基金的发售公告以及当地基金代销机构以各种形式发布的公告。

### （六）募集目标

本基金不设最高募集规模。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，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规的规定可以决定停止基金发售。

### （七）基金份额的认购

除法律、行政法规或中国证监会有关规定另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

### 1、基金的面值

本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

### 2、认购费用

本基金认购费率如下：

购买金额 (M)	认购费率
M < 100 万	1.20%
100 万 ≤ M < 500 万	0.80%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.20%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

### 3、认购份额的计算

基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

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

$$(2) \text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额} ;$$

$$(3) \text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额初始发售面值} .$$

认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者认购金额为 1 万元，由于募集期间基金份额初始发售面值为人民币 1 元，假定募集期间认购资金所得利息为 3 元，则根据公式计算出：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1.20\%) = 9881.42 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9881.42 = 118.58 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (9881.42 + 3) / 1.00 = 9884.42 \text{ 份}$$

### 4、基金份额的认购程序

#### (1) 认购时间安排

投资者认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金代销机构确定，请参见本基金的发售公告。

#### (2) 投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的发售公告。

### （3）基金份额的认购采用金额认购方式

投资者认购本基金采取全额缴款认购的方式。投资者在募集期内可多次认购，认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。投资者的认购申请一经受理不得撤销。

### （4）认购的确认

当日（T日）在规定时间内提交的申请，投资者通常应在 T+2 日到网点查询认购申请的受理结果，并可在募集截止日后 4 个工作日内可以到网点打印交易确认书。

### （5）认购金额的限制

在基金募集期内，投资者可多次认购基金份额，每笔认购的最低金额为人民币 1000 元（含认购费），直销中心首次认购的最低金额为人民币 50000 元（含认购费）。超过最低认购金额的部分不设金额级差。募集期间不设置投资者单个账户最高认购金额限制。各代销机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

## 5、认购期利息的处理方式

认购款项在基金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，认购利息折算的基金份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。利息折成基金份额不收取认购费，不受最低份额限制。

## （八）募集资金的管理

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。

## （九）基金募集情况

本基金募集期限为 2011 年 2 月 28 日起至 2011 年 3 月 25 日。经会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集 5,622,650,211.18 份基金份额（其中包括利息转份额 2,283,083.89 份），有效认购户数为 130,017 户。其中汇添富基金管理股份有限公司于 2011 年 3 月 23 日运用自有资金 30,000,000.00 元认购本基金份额 30,002,300.00 份（含募集期利息结转的份额），认购费用 1,000.00 元；汇添富基金管理股份有限公司基金从业人

员认购本基金基金份额 426,435.62 份（含募集期利息结转的份额），占基金总份额比例 0.0076%。



## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

1、基金募集期限届满，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，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规和招募说明书的规定可以决定停止基金发售。基金管理人应当自基金募集期结束之日起 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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在基金募集期形成的利息在本基金合同生效后折成基金投资者认购的基金份额，归基金投资者所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

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

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后 30 日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计同期银行存款利息。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。

### （四）本基金基金合同于 2011 年 3 月 29 日正式生效。

## 八、基金的申购与赎回

### （一）申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以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的申购与赎回。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将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 2 日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 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，由基金管理人在开始日 2 日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒介上公告。

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。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日相应类别的价格。

本基金于 2011 年 6 月 29 日开始办理 A 类基金份额的日常申购、赎回业务。本基金于 2022 年 3 月 7 日开始办理 C 类和 D 类基金份额的日常申购、赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额的申购与赎回价格以申请当日收市后计算的相应类别的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回时，除指定赎回外，基金管理人按“先进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、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；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒介上予以公告。

#### **（四）申购与赎回的程序**

##### **1、申购和赎回的申请方式**

基金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。

基金投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

##### **2、申购和赎回申请的确认**

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者应在 T+2 日后（包括该日）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。

销售机构对申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申购申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

##### **3、申购和赎回的款项支付**

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### **（五）申购与赎回的数额限制**

投资者通过基金管理人直销中心首次申购本基金 A 类基金份额的最低金额为人民币 50000 元（含申购费），首次申购本基金 C 类、D 类基金份额的最低金额为人民币 100 元；通过基金管理人线上直销系统申购本基金 A 类、D 类基金份额单笔最低金额为人民币 10 元（含申购费）；通过其他销售机构的销售网点申购本基金 A 类、C 类、D 类基金份额单笔最低金额为人民币 10 元（含申购费）。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

1、投资者将当期分配的基金收益转为相应类别的基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

3、投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回最低份额 1 份，基金份额持有人在销售机构保留的基金份额不足 1 份的，注册登记系统有权将全部剩余份额自动赎回。

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额的数量限制。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规定单个投资者申购金额上限、基金规模上限或基金单日净申购比例上限，以及拒绝大额申购、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。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （六）申购费用和赎回费用

1、本基金 C 类、D 类基金份额不收取申购费，A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的基金申购人承担，在投资者申购 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用由基金赎回人承担，具体赎回费用及归入比例见本招募说明书。

#### 3、申购费率

本基金 A 类基金份额的申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：

购买金额（M）	申购费率
M < 100 万	1.50%

100 万 $\leq$ M<200 万	1.00%
200 万 $\leq$ M<500 万	0.30%
M $\geq$ 500 万	每笔 1000 元

本基金 C 类、D 类基金份额不收取申购费。

#### 4、赎回费率

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定。本基金 A 类基金份额和 C 类、D 类基金份额采用不同的赎回费率结构。

(1) 本基金 A 类基金份额赎回费率具体如下：

持有时间 (N)	赎回费率	归入基金资产比例
N<7 天	1.5%	100%
7 天 $\leq$ N<1 年	0.50%	25%
1 年 $\leq$ N<2 年	0.25%	25%
N $\geq$ 2 年	0	--

注：1 年按照 365 天计算。

(2) 本基金 C 类和 D 类基金份额赎回费率具体如下：

持有期限 (N)	赎回费率	归入基金资产比例
N<7 天	1.5%	100%
7 天 $\leq$ N<30 天	0.5%	100%
N $\geq$ 30 天	0	--

5、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

6、基金管理人可以在不违背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，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

#### (七) 申购份额与赎回金额的计算

1、本基金申购份额的计算：

(1) 申购 A 类基金份额

A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

例：某投资者投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.052 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $50000 / (1+1.5\%) = 49261.08$  元

申购费用 =  $50000 - 49261.08 = 738.92$  元

申购份额 =  $49261.08 / 1.052 = 46826.12$  份

即：投资者投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，对应的申购费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.052 元，则其可得到 46826.12 份 A 类基金份额。

### (2) 申购 C 类基金份额

申购份额 = 申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

例：某投资者投资 5 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.052 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 =  $50,000 / 1.052 = 47,528.52$  份

即：某投资者投资 5 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.052 元，则可得到 47,528.52 份 C 类基金份额。

### (3) 申购 D 类基金份额

申购份额 = 申购金额/申购当日 D 类基金份额净值

例：某投资者投资 5 万元申购本基金 D 类基金份额，假设申购当日 D 类基金份额的基金份额净值为 1.052 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 =  $50,000 / 1.052 = 47,528.52$  份

即：某投资者投资 5 万元申购本基金 D 类基金份额，假设申购当日 D 类基金份额的基金份额净值为 1.052 元，则可得到 47,528.52 份 D 类基金份额。

## 2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的该类基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日该类基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 180 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.052 元，则其可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.052 = 10520.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10520.00 \times 0.50\% = 52.60 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10520.00 - 52.60 = 10467.40 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 180 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.052 元，则其可得到的净赎回金额为 10467.40 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。本基金 A 类、C 类和 D 类基金份额将分别计算基金份额净值。

### 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## （八）申购和赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者 T 日赎回基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不实质影响投资者合法权益的前提下，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上公告。

### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。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投资人的申购申请；
- 4、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，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
- 5、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%集中度的情形时。
- 6、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。
- 7、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、4、7 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告，并向中国证监会报备。如果基金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）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金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、证券交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。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，基金管理人应当采取暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。

#### 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，若出现上述第3项所述情形，按基金合同的相关条款处理，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过20个工作日，并在指定媒介公告。投资者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。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介刊登暂停赎回公告。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，并依照有关规定在指定媒介上公告。

### (十一) 巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、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）超过前一日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2、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顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，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；基金投资者未能赎回部分，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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，

无优先权并以该开放日的该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金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) 如果发生巨额赎回,且单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 30%时,本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过 30%比例的赎回申请实施延期办理赎回申请。

对该单个基金份额持有人不超过 30%比例的赎回申请,与当日其他赎回申请一起,按上述(1)、(2)方式处理。如下一开放日,该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前一开放日基金总份额的 30%时,继续按前述规则处理,直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于 30%。

基金管理人在履行适当程序后,有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则,并在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时,基金管理人应在 2 日内通过指定媒介刊登公告,并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,并说明有关处理方法。

连续 2 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,并应当在指定媒介上进行公告。

## (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,基金管理人应依照有关规定在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日,第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个工作日的各类基金份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个工作日的各类基金份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人自行确定公告增加次数，并根据《信息披露办法》在指定媒介刊登公告。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的各类基金份额的基金份额净值。

### （十三）基金的转换

#### 1、基金转换受理场所

基金转换将通过基金管理人的直销中心、线上直销系统及各基金销售代理人的代销网点进行。

#### 2、基金转换受理时间

本基金 A 类基金份额于 2011 年 6 月 29 日开始办理转换业务。本基金 C 类基金份额和 D 类基金份额于 2022 年 3 月 7 日开始办理转换业务。

办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

#### 3、基金转换原则

基金转换采用“份额转换，未知价法”，即转出/转入基金的成交价格以申请当日转出/转入基金的基金份额净值为计算依据，基金份额持有人在办理基金转换时，须缴纳一定的转换费用。

根据中国证监会[2009]32 号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，基金的转换按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取费用。

1) 当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

2) 免申购赎回费用的汇添富货币市场基金转入其他开放式基金，转换申购补差费用为转入基金的申购费。

基金转换以份额为单位进行申请，申请转换份额精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

注册登记机构以收到有效转换申请的当天作为转换申请日（T 日）。投资者转换基金成功的，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理权益转换的注册登记手

续，投资者通常可自 T+2 日（含该日）起向业务办理网点查询转换业务的确认情况，并有权转换或赎回该部分基金份额。

基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的基金。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

基金注册登记人采用“先进先出”原则确认基金转换申请，即注册登记日期在先的基金份额先转出。基金转换后，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前 2 个工作日予以公告。

#### 4、基金转换的计算公式

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率/(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额/转入基金份额净值

基金之间转换费率详见基金转换公告，基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式及费率，但应最迟在适用前 2 个工作日予以公告。

#### 5、基金转换的数额限制

单笔转换份额不得低于 1 份。基金持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

#### 6、暂停基金转换及其他特殊情况

基金转换视为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此暂停基金转换适用有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、暂停赎回和巨额赎回的有关规定。

基金净赎回申请份额（该基金赎回申请总份额加上基金转换中转出申请总份额后扣除申购申请总份额及基金转换中转入申请总份额后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认部分的转出申请将自动予以撤销，不再视为下一开放日的基金转换申请。

#### （十四）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。

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

#### （十五）定期定额投资计划

定期定额投资计划是基金申购业务的一种方式，投资者可通过基金销售机构提交申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请。定期定额投资计划并不构成对基金日常申购、赎回等业务的影响，投资者在办理相关基金定期定额投资计划的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。

投资者可通过经本公司公告可办理本业务的销售机构网点申请办理本业务。本基金管理人可根据情况增减开办该业务的销售机构，并予以公告。

具体办理方法参照《汇添富基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

本基金 A 类基金份额于 2011 年 6 月 29 日开始办理定期定额投资业务，本基金 C 类、D 类基金份额于 2022 年 3 月 7 日开始办理定期定额投资业务。

#### （十六）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。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注册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自申请受理日起 2 个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （十七）基金的冻结与解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与

解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、转出申请、非交易过户以及基金的转托管。

#### **（十八）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”章节的规定或相关公告。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，谋求基金资产的稳健增值。

### （二）投资理念

在长期价值投资理念的基础上，本基金坚持社会责任投资，重点考察企业社会责任的履行，立足企业基本面，“自下而上”精选个股，努力实现本基金的投资目标。

### （三）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，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的 80%。

### （四）投资策略

本基金为混合型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘积极履行社会责任的优质上市公司，以谋求基金资产稳健增值。

#### 1、资产配置策略

本基金管理人综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水

平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场 P/E 与历史平均水平的偏离程度等），结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格管理投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票及存托凭证、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

## 2、个股精选策略

本基金股票投资采用“自下而上”的个股精选策略，精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司。为了深刻理解投资对象的特征，持之以恒地贯彻和保持本基金股票投资风格，本基金管理人应用过滤模型来动态建立和维护核心股票库，审慎精选，严格高效管理风险，力求实现本基金投资目标。

首先，在全部股票中，按照本基金投资范围的界定、本基金管理人投资管理制度要求以及股票投资限制，剔除其中不符合投资要求的股票（包括但不限于法律法规或公司制度明确禁止投资的股票、筹码集中度高且流动性差的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等），筛选得到的公司组成本基金的初选股票库。初选股票库将不定期地更新。

其次，基于初选股票库，本基金管理人从利益相关者责任（包括但不限于上市公司对股东、债权人、职工、国家等的责任）和资源、环境责任（包括但不限于上市公司对生态环保承担的责任）等方面，将净资产收益率、资产负债率、职工获益率、资产纳税率、单位净利润废物排放量等定义为本基金所关注的社会责任指标。各指标具体计算公式如下：

$$\text{净资产收益率} = \text{上市公司净利润} \div \text{上市公司平均净资产} \times 100\%,$$

$$\text{资产负债率} = \text{上市公司负债总额} \div \text{上市公司资产总额} \times 100\%,$$

$$\text{职工获益率} = \text{上市公司支付职工工资、福利及社保基金总额} \div \text{上市公司营业收入总额} \times 100\%,$$

$$\text{资产纳税率} = \text{上市公司企业纳税总额} \div \text{上市公司平均资产总额} \times 100\%,$$

$$\text{单位净利润废物排放量} = \text{上市公司年废物排放量} \div \text{上市公司年净利润} \times 100\%。$$



根据上述社会责任指标，本基金管理人对备选股票进行动态综合评级，选择排名在前 1/3 的上市公司作为积极履行社会责任的上市公司。

在此基础上，本基金管理人通过扎实的案头研究和详尽紧密的实地调研，结合卖方研究的分析，从信息披露、重要股东状况、激励约束机制等方面衡量公司治理结构，从管理层稳定性、工作能力、品行等方面考察管理层，从经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等方面评估竞争优势，从中选择具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司，组成本基金的精选股票库。

然后，在精选股票库的基础上，本基金管理人从内在价值、相对价值、收购价值等方面，考察市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等一系列估值指标，从中选择估值水平相对合理的公司，组成本基金的核心股票库。

最后，基金经理按照本基金的投资决策程序，审慎精选，权衡风险收益特征后，根据二级市场波动情况构建股票组合并动态调整。

本基金可以投资存托凭证，本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

### 3、债券投资策略

本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性，在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上，灵活运用各种消极和积极策略。

消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造一个恰当的债券组合，使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。这样无论市场利率如何变化，债券组合都能获得一个比较确定的收益率。

积极债券投资的目标是利用市场定价的低效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别，它决定于三个要素：货币市场利率、均衡真实利率和预期通货膨胀率。在深入分析利率期限结构的基础上，本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投资。

本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。国内债券市场正处于发展阶段，交易制度、债券品种体系和投资者结构也在逐步完善，这些结构变化会产生低风险甚至无风险的套利机会。本基金将借助经济理论和金融分析方法努力把握市场结构变化所带来的影响，并在此基础上寻求低风险甚至无风险的套利机会，主要通过跨市场套利策略和跨品种套利策略来完成。

#### 4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

### （五）投资决策依据和投资程序

#### 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）国内外宏观经济形势及对中国证券市场的影响；
- （3）国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；
- （4）行业发展现状及前景；
- （5）上市公司基本面；
- （6）股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

#### 2、投资决策机制

本基金实行投资决策团队制，强调团队合作，充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合，设立了投资研究部，策略分析师、行业分析师、金融工程小组和基金经理立足本职工作，充分发挥主观能动性，渗透到投资研究的关键环节，群策群力，为基金份额持有人谋取中、长期稳定的较高投资回报。

#### 3、投资决策程序

本基金投资决策流程为：

- (1) 策略分析师就宏观、政策、投资主题、市场环境提交策略报告并讨论；行业研究员就行业发展趋势和行业组合的估值比较，召开会议讨论确定行业评级；
- (2) 基金经理在策略会议的基础之上提出资产配置的建议；
- (3) 投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议，并确定资产配置比例的范围；
- (4) 投资研究部提交股票库，在此基础上，基金经理、行业研究员决定核心股票库名单；
- (5) 基金经理在考虑资产配置的情况下，经过风险收益的权衡，决定投资组合方案；
- (6) 投资总监审核投资组合方案后，交由基金经理实施；
- (7) 集中交易室执行交易指令；
- (8) 金融工程小组进行全程风险评估和绩效分析。

## **(六) 投资限制**

### **1、禁止行为**

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人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；
- (7) 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；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

### **2、投资组合限制**

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监

会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；

(2) 投资于积极履行社会责任的上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于 80%；

(3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金参与股票发行申购，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；

(7) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(8) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

(9) 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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

(10) 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；

(11) 本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司停牌、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投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以

及中国证监会认可的特殊投资组合除外) 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%; 同一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%;

(13) 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方开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

(14) 本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;

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下, 除上述第(7)、(11)、

(13) 项外因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的, 从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制, 履行适当程序后, 本基金投资可不受上述规定限制。

### (七) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

沪深 300 指数收益率  $\times$  80% + 中证全债指数收益率  $\times$  20%

选择该业绩基准, 是基于以下因素:

- 1、沪深 300 指数编制合理、透明, 有一定市场覆盖率, 并且不易被操纵;
- 2、沪深 300 指数编制和发布有一定的历史, 有较高的知名度和市场影响力;
- 3、沪深 300 指数是中证指数公司编制共同推出的沪深两个市场第一个统一指数;

- 4、中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数, 也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数, 该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成;

- 5、基于本基金的投资范围和投资比例, 选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更业绩比较基准并及时公告。

#### **（八）风险收益特征**

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

#### **（九）基金管理人代表基金行使股东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，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 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。

#### **（十）基金的融资融券**

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

#### **（十一）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”章节的规定。

#### **（十二）基金投资组合报告**

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期自 2020 年 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## § 1 投资组合报告

### 1.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,777,545,557.41	90.20
	其中：股票	1,777,545,557.41	90.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	281,000.00	0.01
	其中：债券	281,000.00	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	191,480,244.61	9.72
8	其他资产	1,394,171.61	0.07
9	合计	1,970,700,973.63	100.00

### 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	80,412,000.00	4.15
C	制造业	959,409,133.40	49.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	239,083,870.41	12.35
J	金融业	280,395,279.52	14.48
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	50,925,200.00	2.63
R	文化、体育和娱乐业	167,225,130.00	8.64
S	综合	-	-
	合计	1,777,545,557.41	91.81

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	60,000	119,880,000.00	6.19
2	601318	中国平安	1,340,000	116,553,200.00	6.02
3	300413	芒果超媒	1,499,988	108,749,130.00	5.62
4	002624	完美世	3,450,000	101,775,000.00	5.26



		界			
5	603444	吉比特	200,000	85,200,000.00	4.40
6	600036	招商银行	1,700,000	74,715,000.00	3.86
7	002415	海康威视	1,499,962	72,763,156.62	3.76
8	300285	国瓷材料	1,400,000	63,154,000.00	3.26
9	000651	格力电器	1,000,000	61,940,000.00	3.20
10	002460	赣锋锂业	600,000	60,720,000.00	3.14

#### 1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	281,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	281,000.00	0.01

#### 1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产
----	------	-----	-------	---------	-------

		称			净值比例 (%)
1	113616	韦尔转 债	2,810	281,000.00	0.01

### 1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

### 1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

### 1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 1.11 投资组合报告附注

#### 1.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

#### 1.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	855,630.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,549.85

5	应收申购款	496,991.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,394,171.61

#### 1.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十、基金的业绩

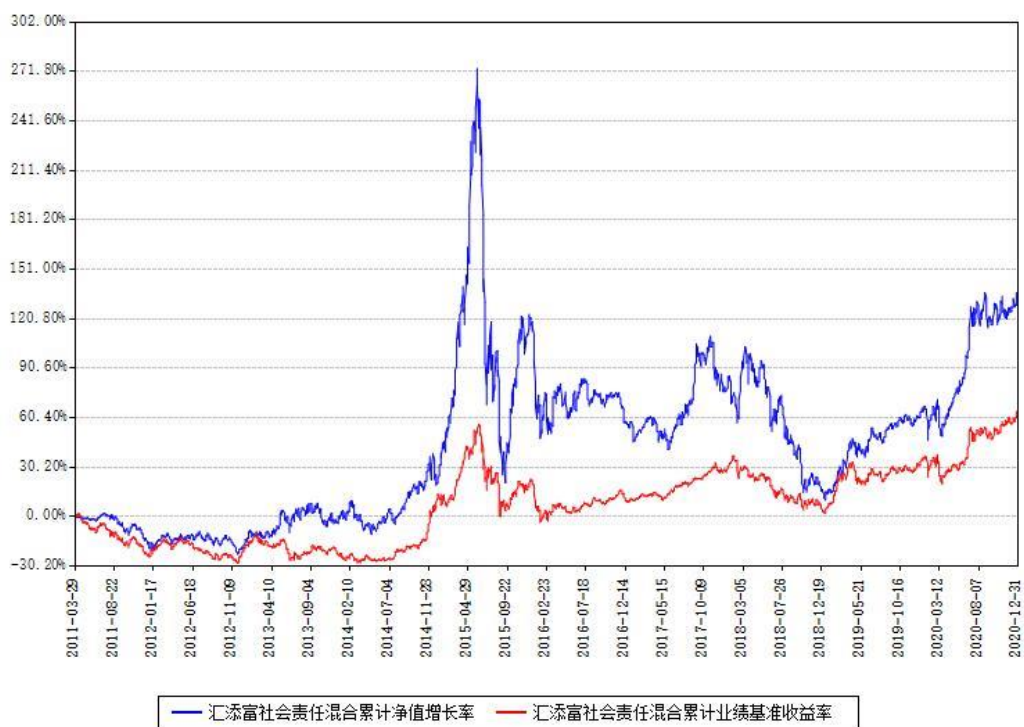
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	净值增长率 (1)	净值增长率标准差 (2)	业绩比较基准收益率 (3)	业绩比较基准收益率标准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2011年3月29日（基金合同生效日）至2011年12月31日	-15.60%	0.75%	-21.85%	1.02%	6.25%	-0.27%
2012年1月1日至2012年12月31日	2.13%	1.07%	6.75%	1.02%	-4.62%	0.05%
2013年1月1日至2013年12月31日	16.13%	1.63%	-6.02%	1.12%	22.15%	0.51%
2014年1月1日至2014年12月31日	20.78%	1.60%	42.85%	0.97%	-22.07%	0.63%
2015年1月1日至2015年12月31日	74.94%	3.59%	7.52%	1.99%	67.42%	1.60%
2016年1月1日至2016年12月31日	-27.04%	2.02%	-8.42%	1.12%	-18.62%	0.90%
2017年1月1日至2017年12月31日	15.10%	1.44%	17.08%	0.51%	-1.98%	0.93%
2018年1月1日至2018年12月31日	-36.26%	2.02%	-19.17%	1.07%	-17.09%	0.95%
2019年1月1日至2019年12月31日	45.05%	1.24%	29.59%	0.99%	15.46%	0.25%
2020年1月1日至2020年12月31日	44.34%	1.47%	22.48%	1.14%	21.86%	0.33%
2011年3月29日（基金合同生效日）至2020年12月31日	137.00%	1.85%	64.41%	1.15%	72.59%	0.70%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图

汇添富社会责任混合累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （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金额。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常交易日，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。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

##### （1）上市股票的估值：

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

##### （2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的估值价格进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的估值价格进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

(1) 在证券交易所市场挂牌交易且实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易且未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(5) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(6) 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。

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值方法：



(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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) 首次发行未上市的权证，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) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### **(五) 估值程序**

基金日常估值由基金管理人进行。各类基金份额的基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### **(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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、差错类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方

承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当任一类基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过该类基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿

金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事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交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；

4、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；

5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### **(八) 基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的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工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

各类基金份额净值的计算均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### **(九) 特殊情形的处理**

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### **（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。

## 十三、基金的收益分配

### （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）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金同一类别内每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于该次收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 3、基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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；
- 5、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、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

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告。

2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **（六）收益分配中发生的费用**

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，注册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”章节的规定。

## 十四、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、基金的销售服务费；
- 4、基金合同生效后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金财产划拨支付的银行费用；
- 9、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

### （三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数} \quad (\text{本基金年管理费率为 } 1.50\%)$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托，于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数} \quad (\text{本基金年托管费率为 } 0.25\%)$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值



基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、基金的销售服务费

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按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该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，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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、上述“（一）基金费用的种类”中4到9项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### （四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

### （五）费用的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

### （七）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”章节的规定。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。基金管理人应当依据有关规定在指定媒介上公告。

## 十六、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》、基金合同及其他有关规定。

### （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中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”，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在承诺公开披露的基金信息时，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：

## 1、招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

(1) 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。本基金合同生效后，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指定网站上；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。

(2) 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事项的法律文件。

(3) 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，并登载在指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。

## 2、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发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

## 4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前在指定媒介上公告。

## 5、基金净值信息

本基金合同生效后, 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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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, 通过指定网站、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的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日, 在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 6、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, 将年度报告登载在指定网站上, 并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格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, 将中期报告登载在指定网站上, 并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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, 将季度报告登载在指定网站上, 并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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。

基金管理人应在中期报告、年度报告等文件中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

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, 为保障其他投资者利益, 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有风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。

#### 7、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, 并登载在指定报刊和指定网站上。

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；
- (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) 涉及基金管理业务、基金财产、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 0.5%；
- (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) 基金推出新业务或服务；

(22) 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时；

(23) 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。

## 8、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，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，并将有关情况立即报告中国证监会。

## 9、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。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

## 10、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

## 11、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”章节的规定。

## 12、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、各类基金份额的基金份额净值、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、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。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指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指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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。

投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

#### （八）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

市场风险是指证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而变化，导致收益水平存在的不确定性。市场风险主要包括：

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、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。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

6、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

7、债券收益率曲线风险。债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

8、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率

9、波动性风险。波动性风险主要存在于可转债的投资中，具体表现为可转债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债还有信用风险与转股风

险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

## （二）管理风险

在基金管理运作过程中，管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

## （三）流动性风险

流动性风险是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。中国的证券市场还处在初期发展阶段，在某些情况下某些投资品种的流动性不佳，由此可能影响到基金投资收益的实现。开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使基金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

### 1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

#### （1）投资市场的流动性风险

本基金主要投资于股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。上述资产均在规范的交易场所、运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

#### （2）投资行业的流动性风险

股票投资方面，本基金将在考虑行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场行业轮动规律的基础上决定行业的配置，同时本基金将根据宏观经济和证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。

债券投资方面，本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债

券和货币市场工具组合。

因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一细分行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

### （3）投资资产的流动性风险

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：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%。

本基金为开放式基金，为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险。同时，结合市场流动性特点，本基金将合理安排组合流动性，统筹考虑投资者申购赎回特征和客户大额资金流向特征，以确定本基金在不同投资品种的配置比例，确保流动性充裕。

## 2、本基金申购、赎回安排

本基金为普通开放式基金，投资人可在本基金的开放日办理基金份额的申购和赎回业务。为切实保护存量基金份额持有人的合法权益，遵循基金份额持有人利益优先原则，本基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

（1）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规定单个投资者申购金额上限、基金规模上限或基金单日净申购比例上限，以及拒绝大额申购、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。

（2）本基金管理人对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

（3）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、赎回申请或延缓支付赎回款项。

具体措施详见本招募说明书“八、基金的申购与赎回”。

## 3、巨额赎回情形下流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- (1) 延缓办理巨额赎回申请；
- (2) 暂停接受赎回申请；
- (3) 延缓支付赎回款项；
- (4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施详见本招募说明书“八、基金的申购与赎回”。

#### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商一致，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。

当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人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，可综合运用包括延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、侧袋机制等流动性风险管理工具，投资者将面临其赎回申请被拒绝或延期办理、赎回款项延缓支付，或面临赎回成本或申购成本较高等的风险。

#### （四）特定风险

本基金是主动管理的较高预期风险较高预期收益型证券投资基金，其投资风格和决策过程决定了基金具有如下特有风险：

##### 1、本基金特有风险

本基金坚持社会责任投资，精选积极履行社会责任，并具有良好的公司治理结构、诚信优秀的管理层、独特核心竞争优势的优质上市公司。由于社会责任概念引入中国的时间较短，上市公司可以量化的指标及相关信息较少，因此，本基金可能面临短期内投资标的相对较少的风险。

##### 2、其它投资风险。

本基金的特有投资风格和决策过程决定了基金具有许多其它的特有风险。比如本基金把权证作为辅助性投资工具，权证是高风险投资工具，权证市场的波动也可能给基金带来风险。

3、基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、科创板企业退市风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

投资科创板股票存在的风险包括：

① 市场风险

科创板股票集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，上市门槛略低于 A 股其他板块，企业未来盈利、现金流、估值等均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，个股价格风险加大。同时，科创板股票可能存在股价波动较大的风险。科创板企业普遍具有技术性、前景不确定、业绩波动大、风险高的特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大。考虑到科创板竞价交易设置较宽的涨跌幅限制（上市前五日无涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%）、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，股票价格波动可能较其他板块更大。

② 流动性风险

科创板整体投资门槛较高，投资者数量较少，基金资产存在无法及时或以公允价格变现及其他相关流动性风险。

③ 科创板企业退市风险

科创板退市机制比 A 股其他板块更严格，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的股票进入退市流程，将面临退出难度较大、成本较高的风险。

④ 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

4、存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，除普通股票投资可能面临的宏观经济风险、政策风险、市场风险、流动性风险外，投资存托凭证可能还会面临以下风险：

1) 存托凭证持有人与持有基础股票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

存托凭证系由存托人以境外发行的证券为基础，在中国境内发行的代表境外基础证券权益的证券。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。存托凭证持有人与境外基础证券发行人股东之间在法律地位、享有权利等方面存在一定的差异。境外基础证券发行人股东为公司的直接股东，可以直接享有股东权利（包括但不限于投票权、分红等收益权等）；存托凭证持有人为间接拥有公司相关权益的证券持有人，其投票权、收益权等仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并间接行使分红、投票等权力。若未来发行人或存托人未能履行存托协议的约定，不对存托凭证持有人进行分红派息或者分红派息金额少于应得金额，或者存托人行使股东表决权时未充分代表存托凭证持有人的共同意见，则存托凭证持有人的利益将受到损害，本基金作为存托凭证持有人可能会面临一定的投资损失。

#### 2) 发行人采用协议控制架构的风险

境外基础证券发行人如采用协议控制架构，可能由于法律、政策变化带来合规、经营等风险，可能面临对境内实体运营企业重大依赖、协议控制架构下相关主体违约等风险。

#### 3) 增发基础证券可能导致的存托凭证持有人权益被摊薄的风险

存托凭证发行时，其对应的净资产已经固定，但未来若发行人增发基础证券，将会导致存托凭证持有人权益被摊薄。

#### 4) 交易机制相关风险

境外基础证券与境内存托凭证由于时差、交易时间、交易制度、停复牌规则、异常交易情形、做空机制等差异，境内存托凭证的交易价格可能受到境外市场影响，从而出现大幅波动。此外，在境内法律及监管政策允许的情况下，发行人现在及将来境外发行的股票或存托凭证可能转移至境内市场上市交易，从而增加境内市场的存托凭证供给数量，可能引起交易价格大幅波动。

#### 5) 存托凭证退市风险

如果发行人不再符合上市条件或者发生其他重大违法行为，可能导致存托凭证面临退市。基金作为存托凭证持有人可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券、持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让、存托人无法继续按照存托协议的约定为基金提供相应服务等风险。

#### 6) 其它风险

存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改、更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对投资者生效。本基金作为存托凭证投资者可能无法对此行使表决权。

存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，本基金作为存托凭证投资者可能面临失去应有权利的风险。

存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

#### 5、启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露基金净值信息，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额。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。

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### （五）操作或技术风险

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公司、注册登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### **（六）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。

#### **（七）其他风险**

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

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 十八、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，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额。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，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

### （二）侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### 1、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

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。

本招募说明书“基金的申购与赎回”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上一日主袋账户总份额的 10% 认定。

#### 2、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；且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。

### 3、基金的费用

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。

主袋账户的管理费和托管费等费用仍按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

### 4、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。

### 5、基金的信息披露

#### (1) 基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“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净值信息。侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户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，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。

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

#### (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。

### 6、特定资产处置清算

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的款项。

#### 7、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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则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，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。

## 十九、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、按照法律法规或本基金合同的规定，以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （5）变更基金份额持有人大会议事程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低 C 类、D 类基金份额的销售服务费率、调低赎回费率、调整基金份额类别设置或变更或增加收费方式；
- （3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）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；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- 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

（1）基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金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）基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估价和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将基金清算结果报告中国证监会；
- （8）公布基金清算报告；
- （9）对基金剩余财产进行分配。

#### 3、清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金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) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### 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 15 年以上。

## 二十、基金合同的内容摘要

### <一> 基金合同当事人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。

##### 1、基金份额持有人的权利包括：

- (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；
- (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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

##### 2、基金份额持有人的义务包括：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- (3) 在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；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### (二) 基金管理人的权利与义务

##### 1、基金管理人的权利包括：



(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照本基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(3) 依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(7) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(8) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务包括：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

(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、勤勉尽责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财产分别管理，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) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(13) 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；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

(15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时足额向基金份额持有人分配收益；

(16) 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；

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(18) 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者实施其他法律行为；

(19) 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；

(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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人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托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 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；

(27) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **1、基金托管人的权利包括：**

(1) 获得基金托管费；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册；

(8) 法律法规规定的其他权利。

#### **2、基金托管人的义务包括：**

(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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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和证券账户；

(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应予保密，不得向他人泄露；

(8) 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；

(9) 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少于 15 年；

(10) 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；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

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

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 〈二〉基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

### （一）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### （二）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：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式；

（3）变更基金类别；

（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

（5）变更基金份额持有人大会议事程序；

（6）更换基金管理人、基金托管人；

（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

（10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，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）调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低 C 类、D 类基金份额的销售服务费率、调低赎回费率、调整基金份额类别设置或变更或增加收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 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；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、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，应当自行召集。

3、代表基金份额 10% 以上（以上含本数，下同）的基金份额持有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。

4、代表基金份额 10% 以上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，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、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。

#### **（四）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、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- （6）授权委托书的内容要求（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；
- （7）表决方式；
- （8）会务常设联系人姓名、电话；
- （9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （10）召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表达意见的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书面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书面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书面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，不影响计票和表决结果。

#### **（五）基金份额持有人出席会议的方式**

##### **1、会议方式**

- （1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- （2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

## 2、召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上(含 50%，下同)；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

4) 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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。



## （六）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

（3）对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

### 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表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。

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）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

## （2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、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。

## （七）决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列（2）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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4、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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、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。

## （八）计票

### 1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

（3）如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）计票过程应由公证机关予以公证。

### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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（如果基金托管人为召集人，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

### **(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式**

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

2、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。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定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。

4、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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### **(十) 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。

### **<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、按照法律法规或本基金合同的规定，以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （5）变更基金份额持有人大会议事程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低 C 类、D 类基金份额的销售服务费率、调低赎回费率、调整基金份额类别设置或变更或增加收费方式；
- （3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

- (5) 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；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## **(二) 本基金合同的终止**

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- 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**

(1) 基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金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) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算报告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

### **3、清算费用**

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金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) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### 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 15 年以上。

### <四> 争议解决方式

对于因本基金合同产生或与本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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

### <五> 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### <一> 基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市黄浦区外马路 728 号

邮政编码：200010

法定代表人：李文

成立日期：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】5 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 132,724,224 元

存续期间：持续经营

电话：（021）28932888

传真：（021）28932998

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理以及经中国证监会许可的其他业务。

#### (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

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：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

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＞ 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、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，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1、本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；

2、本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的 80%；

3、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；

5、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%。债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

6、本基金参与股票发行申购，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；

7、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 5%；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

8、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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

9、本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

10、一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；本款所指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；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；经基金管理人和托管人协商，履行适当程序后可对以上比例进行调整；

11、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；

12、本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司停牌、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投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

13、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（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认可的特殊投资组合除外）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%；同一基金管理人管理的、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%；

14、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方开展逆回购交易的，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；

15、本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；

16、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第（9）（12）、（14）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

（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九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，如基金托管人事前已严格遵循了监督流程仍无法阻止该关联交易的发生，而只能按相关法律法规和交易所规则进行事后结算，则基金托管人不承担由此造成的损失，并应向中国证监会报告。

（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，对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、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。

（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，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《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。

（七）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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项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。

（八）基金管理人负有义务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。

（九）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。

（十）基金管理人应对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资产净值和各类基金份额的基金份额净值、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。

（十一）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。

（十二）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。

### **<三> 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，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。
- 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。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。
- 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银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格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，未能达到基金合同生效的条件，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，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的有关规定，在中央国债登记结算有限责任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、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由基金托管人负责开立。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。托管人对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为基金合同终止后 15 年。

### **<四> 基金资产净值的计算与复核**

#### **（一）基金资产净值的计算及复核程序**

## 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。各类基金份额的基金份额净值的计算，均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

## 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将各类基金份额的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，由基金管理人对外公布。

### (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1、估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产和负债。

#### 2、估值方法

##### (1) 股票估值方法：

##### 1) 上市股票的估值：

上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

##### 2) 未上市股票的估值。

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 2) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1) — 2) 小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

- 4) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。
- 5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(2) 债券估值方法：

1) 在证券交易所市场挂牌交易且实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易且未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

5) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

6) 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。

7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 6) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1) — 6) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

- 8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### (3) 权证估值方法:

1) 基金持有的权证, 从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 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) 首次发行未上市的权证, 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) 因持有股票而享有的配股权, 以及停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产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, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(4) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

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。

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 3) 项、债券估值方法的第 7) 项、权证估值方法的第 4) 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

### (三) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当任一类基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时, 视为该类基金份额净值错误; 基金份额净值出现错误时, 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; 错误偏差达到或超过该类基金资产净值的 0.25% 时, 基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会; 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.50% 时, 基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案; 当发生净值计算错误时, 由基金管理

人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 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。如果行业有通行做法，双方当事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。

#### (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

- (1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- (3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；
- (4) 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；
- (5) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### **(五) 基金会计制度**

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### **(六) 基金账册的建立**

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### **(七) 基金财务报表与报告的编制和复核**

##### **1、财务报表的编制**

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；《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指定网站上；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。季度报告应在季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；中期报告在上半年结束之日起两个月内编制完毕并予以公告；年度报告在每年结束之日起三个月内编制完毕并予以公告。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。

##### **2、报表复核**

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管

理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

**(八)基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。**

#### **<五> 基金份额持有人名册的登记与保管**

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注册登记机构编制，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，保存期限为 15 年。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。

## <六> 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，对当事人均有约束力。

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。

## <七> 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核准后生效。

### （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资产；
- 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权；
- 4、发生法律法规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）基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金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) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金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) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 编制清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算报告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

## 3、清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金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) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

## 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 15 年以上。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人注册登记服务

基金管理人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金管理人将配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管；基金转换和非交易过户；基金份额持有人名册的管理；权益分配时红利的登记派发；基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）交易资料的寄送

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的 2 个工作日后（即 T+2 日起），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。基金成立后的 30 个工作日内，基金管理人将向投资者寄送包含基金账户信息在内的对账单。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的 2 个工作日后（即 T+2 日起），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。基金成立后的 30 个工作日内，基金管理人将向投资者寄送包含基金认购确认信息在内的对账单。

3、基金交易对账单的寄送频率为每季度寄送，每季度对基金份额持有人寄送一次对账单（要求不予寄送的除外）。季度对账单于每季结束后 15 个工作日内以书面或电子邮件形式寄送，记录基金份额持有人最近一季度内所有申购、赎回、修改分红方式等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户余额等。

### （三）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供 24 小时自动语音查询服务。基金份额持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询、基金产品与相关服务等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天，每天不少于 12 小时的人工热线咨询服务。基金份额持有人可通过全国统一客服热线：400-888-9918（免长途话费）享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### （四）网上交易服务

本基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人

网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

#### **（五）定期定额投资计划**

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

#### **（六）网络在线服务**

基金份额持有人登录基金管理人网站（[www.99fund.com](http://www.99fund.com)），通过基金账户（或开户证件号码）和查询密码，可享受账户查询等在线服务。基金管理人为投资者预设基金查询密码，预设的基金查询密码为投资者开户证件号码的后 6 位。投资者在开户成功后，请及时拨打客服热线电话或登录网站自助修改查询密码。

基金管理人利用自己的网站定期或不定期为基金投资者提供投资策略报告、投资者服务刊物以及与投资者交流互动服务。

#### **（七）信息定制服务**

基金份额持有人可以登录基金管理人网站（[www.99fund.com](http://www.99fund.com)），或拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按基金份额持有人的定制提供信息。可定制的信息包括：每周基金份额净值、月度电子对账单、投资者服务刊物、分红公告、公司公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

#### **（八）投资者投诉受理服务**

投资者可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、基金管理人网站留言栏目、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉、网站留言是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务中心负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复；对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在投诉送达基金管理人的 24 小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，顺延至下一工作日完成回复。

客户服务中心邮箱：[service@99fund.com](mailto:service@99fund.com)

## 二十三、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过中国证监会规定媒介进行公开披露。

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1.	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020-03-30
2.	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020-04-01
3.	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020-04-14
4.	汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020-04-21
5.	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金 (FOF) 资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告	中证报, 公司网站	2020-04-29
6.	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	上证报, 公司网站	2020-05-16
7.	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	证券时报, 公司网站	2020-06-04
8.	汇添富基金旗下 151 只基金 2020 年 2 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020-07-21
9.	汇添富基金管理股份有限公司关于调整特定投资群体通过直销中心申购旗下部分基金的费率优惠方案的公告	上证报, 公司网站	2020-08-06
10.	汇添富基金管理股份有限公司关于在网上直销系统开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	中证报, 公司网站	2020-08-19
11.	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020-08-28
12.	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金产品资料概要	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020-08-31
13.	汇添富基金管理股份有限公司关于设立南京分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020-09-05

14.	汇添富基金管理股份有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报, 公司网站	2020-10-28
15.	汇添富基金旗下 160 只基金 2020 年 3 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020-10-28
16.	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020-11-04
17.	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020-11-13
18.	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金调整申购费并修订基金招募说明书和产品资料概要的公告	上证报, 公司网站	2020-11-13
19.	汇添富基金管理股份有限公司旗下 125 只基金更新招募说明书及产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2020-11-17
20.	汇添富基金管理股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报, 公司网站	2020-12-09
21.	汇添富基金管理股份有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	证券时报, 公司网站	2020-12-19
22.	汇添富基金管理股份有限公司关于在直销中心开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020-12-24
23.	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京电盈基金销售有限公司合作关系的公告	中证报, 公司网站	2020-12-28
24.	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	上交所, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020-12-30
25.	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	公司网站, 上交所, 上证报, 深交所	2021-01-09
26.	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	公司网站, 上交所, 上证报, 深交所	2021-01-22
27.	汇添富基金管理股份有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站	2021-02-08
28.	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年年度报告	公司网站, 上交所, 上证报, 深交所	2021-03-30
29.	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	公司网站, 上交所, 上证报, 深交所	2021-04-20
30.	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	公司网站, 上交所, 深交所	2021-04-21

## 二十四、招募说明书的存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站([www.99fund.com](http://www.99fund.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十五、备查文件

### （一）本基金备查文件包括下列文件

- 1、中国证监会核准汇添富社会责任股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富社会责任混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富社会责任混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集汇添富社会责任股票型证券投资基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

汇添富基金管理股份有限公司

2022年3月9日