

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2025年1月27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：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

本基金由汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金更名而来。

汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金经 2009 年 11 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】1221 号文核准募集，基金合同于 2010 年 6 月 25 日正式生效。

2014 年 1 月 8 日，汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，会议审议通过了《关于修改基金名称及投资细节的议案》，基金管理人同时将大会决议报中国证券监督管理委员会备案。2014 年 1 月 17 日，中国证券监督管理委员会印发了《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]23 号），汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议报中国证监会备案手续完成，持有人大会决议生效。即日起，原《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金合同》失效，《汇添富香港优势精选股票型证券投资基金基金合同》生效，基金更名为“汇添富香港优势精选股票型证券投资基金”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。

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“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》，汇添富香港优势精选股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 5 日起更名为汇添富香港优势精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）。

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 2023 年 2 月 7 日发布公告《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金增设基金份额并修改法律文件的公告》，决定自 2023 年 2 月 7 日起本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 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。

本基金投资于海外证券市场，基金净值会因为所投资证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，从而获取基金投资收益，并承担相应的投资风险。本基金投资中的风险主要分为：一是境外投资产品风险，包括市场风险、汇率风险和政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险、会计核算风险、税务风险、法律风险和衍生品风险等。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金招募说明书“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尽相同，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。

本次招募说明书更新主要涉及基金的费用与税收章节，更新所载内容截止日为2025年1月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2024年9月30日。

## 目录

一、 绪言.....	4
二、 释义.....	5
三、 风险揭示.....	12
四、 基金的投资.....	18
五、 基金的业绩.....	35
六、 基金管理人.....	38
七、 基金的历史沿革.....	51
八、 基金的存续.....	52
九、 基金份额的申购和赎回.....	53
十、 基金的费用与税收.....	64
十一、 基金的财产.....	67
十二、 基金资产估值.....	69
十三、 基金的收益与分配.....	74
十四、 基金的会计与审计.....	76
十五、 基金的信息披露.....	77
十六、 侧袋机制.....	84
十七、 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	87
十八、 基金托管人.....	90
十九、 境外托管人.....	95
二十、 相关服务机构.....	98
二十一、 基金合同的内容摘要.....	100
二十二、 基金托管协议的内容摘要.....	128
二十三、 基金份额持有人服务.....	148
二十四、 其他应披露事项.....	150
二十五、 招募说明书存放及其查阅方式.....	152
二十六、 备查文件.....	153

## 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》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》(以下简称《试行办法》)、《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》(以下简称《通知》)、《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》)以及《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、 释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

本合同、《基金合同》	指《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效的修订和补充
中国	指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《试行办法》	指《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》
《通知》	《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》
《流动性风险管理规定》	指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》
元	指中国法定货币人民币元
基金或本基金	指依据《基金合同》所募集的汇添富香港优势精选混合型证券投资基金
《招募说明书》	指《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金招募说明书》，即供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其更新
托管协议	指基金管理人与基金托管人签订的《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
《发售公告》	指《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金份额发售公告》

《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》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
外管局	指国家外汇管理局或其授权的代表机构
基金管理人	指汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司
境外托管人	指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
境外投资顾问	指符合法律法规规定的条件，根据基金管理人与其签订的合同，为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务的境外金融机构。基金管理人有权根据基金运作情况选择、更换或撤销境外投资顾问
基金份额持有人	指根据《招募说明书》和《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金代销机构	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基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

基金注册登记机构	指汇添富基金管理股份有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受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
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
投资者	指个人投资者、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
基金中的基金	指投资对象为证券投资基金的基金，其投资组合由各种基金组成
募集期	指自基金份额发售之日起不超过3个月的期限
基金存续期	指《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
境外主要市场	指本基金主要投资的、与中国证监会签订了双边监管合作谅解备忘录的国家和地区，包括中国香港、澳大利亚、新加坡和新西兰；基金管理人可根据证券市场环境、基金投资组合构成情况和业绩比较基准等的变化，调整对境外主要市场的解释，并在招募说明书更新中列示
日/天	指公历日
月	指公历月



工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T 日	指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	指在本基金募集期内投资者购买本基金基金份额的行为
发售	指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	指《基金合同》生效后，投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
赎回	指《基金合同》生效后，基金份额持有人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月的时间开始办理
巨额赎回	指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的账户
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金转换	指投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	指基金投资所得的股票红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约
基金资产总值	指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
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的过程
货币市场工具	指银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的金融工具
公司行为信息	指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动，及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息，包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息

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
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
基金份额类别	根据申购费用、销售服务费收取方式的不同及销售方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，各基金份额类别分别设置代码、计算公告基金份额净值和基金份额累计净值
A 类基金份额	指在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费用，不从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额
C 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，在赎回时收取赎回费用的基金份额
不可抗力	指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件或因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、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等
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
基金产品资料概要	指《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
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
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

### 三、 风险揭示

本基金主要投资于香港证券市场，基金净值会因为香港证券市场波动等因素产生波动。基金投资中出现的风险分为如下两类，一是境外投资产品风险，包括市场风险、汇率风险、政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险、衍生品风险等。

#### 一、境外投资产品风险

##### 1、市场风险

市场风险是指由于市场因素如基础利率、汇率、股票价格和商品价格的变化或由于这些市场因素的波动率的变化而引起的证券价格的非预期变化，并产生损失的可能性。

由于本基金将投资于香港证券市场，因此一方面基金净值会因香港证券市场的整体变化而出现价格波动。另一方面，香港地区在处于不同的产业经济循环周期的情况下，也将对基金的投资绩效产生影响。

##### 2、汇率风险

一方面，本基金每日的净资产价值以人民币计价，因此当汇率发生变动时，将会影响到人民币计价的净资产价值。另一方面，对应资产可能投资于以非美元报价的各类资产，因此非美元资产的表现将受资产所持货币兑美元的汇率变动所影响。

##### 3、政治风险

本基金以香港为主要的投资地区，因此香港地区政治、社会或经济情势的变动(包括自然灾害、战争、暴动或罢工等)，都可能对本基金所参与的投资市场或投资产品造成直接或者是间接的负面冲击。本基金将在内部及外部研究机构的支持下，密切关注香港地区政治、经济和产业政策的变化，适时调整投资策略以应对政治风险的变化。

#### 二、开放式基金风险

##### 1、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率风险

是债券投资所面临的主要风险，息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平。国家或地区的利率变动还将影响该地区的经济与汇率等。

## 2、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级变化或市场对某一信用等级水平下债券利率的变化都会迅速地改变债券的价格，从而影响到基金资产。投资标的可能因财务结构恶化或整体产业衰退，致使专业评级机构调降该投资标的的债信，进而使得该投资标的产生潜在资本损失的风险。但本基金主要采取股票组合管理，信用风险相对较低。衍生品有一定的交易对手信用风险，可通过严格筛选交易对手来控制。

## 3、流动性风险及风险管理方法说明

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。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，或者变现为现金时对基金资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

本基金投资范围为香港证券市场公开上市的股票、固定收益产品、基金、货币市场工具等金融工具。上述资产均存在规范的交易场所、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，本基金将在考虑各细分行业生命周期、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各细分行业的配置，同时本基金将根据

宏观经济和证券市场环境的变化，及时对各细分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：针对境外市场投资，基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%。

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“九、基金份额的申购和赎回”。

### （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“九、基金份额的申购和赎回”。

### （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。

## 4、操作风险

操作风险主要是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原因可能引致风险。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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金



托管人、境外资产托管人、登记结算机构、销售机构、证券交易所等等。

#### 5、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险，如经常性的串户，帐务记重，透支，过失付款，资金汇划系统款项错划，日终轧帐假平，会计备份数据丢失，利息计算错误等。通过双会计制以及基金会计核算、托管方会计复核的方法可以有效控制会计核算风险。

#### 6、税务风险

在投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。各国、地区的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该等国家或地区缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。本基金在投资香港证券市场时会事先了解清楚当地的税务法律法规。同时，在境外托管人的协助下，完成投资所在地区的税务扣缴工作。

#### 7、法律风险

指由于交易合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给交易者带来损失的可能性。

法律风险主要来自两个方面：一是合约的不可实施性，包括合约潜在的非法性，对手缺乏进行该项交易的合法资格，以及现行的法律法规发生变更而使该合约失去法律效力等；二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行平仓交易。对于法律风险，本基金将本着审慎的原则按照中国证监会的要求选择交易对手，同时，关注相应地区法律环境的变化，有效规避法律风险。

#### 8、衍生品风险

衍生工具是为了有效管理金融风险而设计的工具，一般是一种私人合约，其价值是从一些基础资产价格、参考利率或指数中派生出来的。由于事先不存在现金流，所以衍生工具有杠杆作用，即涉及借款问题。然而，杠杆作用是一把双刃剑。一方面，由于交易成本非常低，杠杆作用可使衍生工具成为一种对冲风险和投机的有效工具；另一方面，由于不存在事先的现金支付，因此就更加难以评估

潜在的下跌风险。

巴塞尔银行监管委员会于 1994 年 7 月 27 日发表《衍生产品风险管理指南》，把衍生品的风险类型归为五类：市场风险(Market Risk)、信用风险(Credit Risk)、流动性风险(Liquidity Risk)、操作风险(Operational Risk)和法律风险(Law Risk)。

本基金投资衍生品的目的是为了对冲风险，而不是投机，会通过控制规模、计算风险价值等手段来有效控制风险。

#### 9、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。

## 四、 基金的投资

### 一、 投资目标

在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。

### 二、 投资范围

本基金投资范围为香港证券市场公开上市的股票、固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构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，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于股票的基金资产占基金资产总值的比例为60%-95%；其余基金资产投资于固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为5%-40%，其中基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券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。

在有关法律法规发生变动时，本基金资产配置比例等应作相应调整。

### 三、 投资理念

本基金坚持长期价值投资的理念，通过深入的“自下而上”的企业基本面分析，精选具有持续竞争优势的公司，在香港证券市场估值比较的基础上，进行中长期的投资布局。我们相信，企业的持续竞争优势必将在股票价格上得到充分反映。本基金通过选择香港证券市场中具有持续竞争优势的公司证券以及投资于上述证券的基金等进行科学的组合管理，优化组合的风险收益特征，实现基金资产的持续稳健增值。

### 四、 投资策略

本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用

“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。

### 1、资产配置策略

本基金在资产配置中采用“自上而下”的策略，对全球经济形势、大中华地区的经济发展状况、地区及产业竞争优势和证券市场估值水平等，采用情景分析法，分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具的预期风险收益特征。在上述分析的基础上，在有效控制基金投资组合风险和符合基金合同投资比例的前提下，确定基金的资产配置比例并形成建议报告。

### 2、股票投资策略

本基金股票投资对象是股价没有充分反映价值的具有持续竞争优势的企业。本基金精选组合成份股的过程具体分为两个层次进行：第一层次，企业竞争优势评估。通过深入的案头分析和实地调研，发现在经营中具有一个或多个方面的持续竞争优势、管理出色且财务透明稳健的企业；第二层次，估值精选。基于定性定量分析、动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的估值方法，选择股价没有充分反映价值的股票进行投资及组合管理。只要一个企业保持和提升它的竞争优势，本基金就作长期投资。如果一个企业丧失了它的竞争优势或它的股价已经超过其价值，本基金就将其出售。

### 3、基金投资策略

本基金也通过翔实的案头研究和深入的实地调研，结合定量和定性分析，精选出优秀的偏股型基金进入组合，它具有以下特征：（1）由历史业绩出色、发展态势良好和拥有强大投资研究团队的基金管理公司管理；（2）符合本基金的投资目标和投资限制等规定；（3）拥有与本基金相似投资理念，立足于“自下而上”的基本面分析，坚持长期价值投资的理念。

### 4、固定收益产品投资策略

本基金的固定收益投资是股票投资的补充。将在综合考虑固定收益产品收益、风险和流动性情况，在深入分析大中华地区宏观经济发展、货币政策以及市场结构的基础上，灵活运用积极和消极的固定收益投资策略。

消极固定收益投资策略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。积极固定收益投资策略的目标是利用市场定价的短暂无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。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。

#### 5、衍生工具投资策略

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资。衍生品投资的主要策略包括：利用指数衍生品，降低基金的市场整体风险；利用股票衍生品，提高基金的建仓或变现效率，降低流动性成本等。

此外，在符合有关法律法规规定并且有效控制风险的前提下，本基金还将进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益，保障投资者的利益。

未来，随着香港证券市场投资工具的丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并及时进行公告。

### 五、投资决策依据和决策程序

#### （一）决策依据

- 1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- 2、大中华地区宏观经济形势、货币政策、产业政策以及证券市场政策等对香港证券市场的影响；
- 3、各行业发展现状及前景；
- 4、上市公司基本面及成长前景；
- 5、股票、固定收益产品、货币市场工具等类别资产的预期收益率及风险水平。

#### （二）决策程序

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，设立了投资研究部和金融工程部，策略分析师、行业分析师、金融工程分析师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。

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；行业分析师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、行业分析师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、金融工程部进行全程风险评估和绩效分析。

## 六、投资限制

### （一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、购买不动产；
- 5、购买房地产抵押按揭；
- 6、购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- 7、购买实物商品；
- 8、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- 9、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- 10、参与未持有基础资产的卖空交易；
- 11、购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- 12、直接投资与实物商品相关的衍生品；

13、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

14、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## （二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

2、基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。

3、不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

4、基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

5、基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

6、基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

7、本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金资产净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制。

8、同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

9、为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净

值的 10%。

10、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。

若基金超过上述 1-10 项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

### （三）金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1、本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2、本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3、本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

（1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

（2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

（3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4、基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

### （四）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2、应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3、借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4、除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：



- (1) 现金；
- (2) 存款证明；
- (3) 商业票据；
- (4) 政府债券；

(5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5、本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6、基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(五) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2、参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3、买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4、参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5、基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(六) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

## 七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：MSCI 中华指数（MSCI ZhongHua Index）。

摩根士丹利资本国际指数 (MSCI)<sup>1</sup>是摩根士丹利资本国际公司主持开发的一系列全球性证券市场指数,是全球投资组合经理作为投资基准最为广泛应用的指数,目前有 2000 多家国际机构投资者采用 MSCI 指数作为基准。

摩根士丹利资本国际公司中华指数 (MSCI ZhongHua Index), 提供了中国投资空间除 A 股外的其他具有代表性的样本,涵盖了 H 股、B 股、红筹股、香港上市的中国内地私企股和香港本地股,为国际机构在香港证券市场投资中广泛使用。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、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业绩比较基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

## 八、风险收益特征

本基金为投资于香港证券市场的主动混合型基金,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、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;
- 2、有利于基金资产的安全与增值;
- 3、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;
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益。

<sup>1</sup> 业绩比较基准使用特别说明:

根据 MSCI 公司要求,向您做如下免责声明: MSCI 信息仅供您自行使用,不得以任何方式进行复制或再次传播,并且也不能被用作任何金融工具,金融产品或者指数的基础或者组成部分。任何 MSCI 信息皆不旨在构成投资建议,也不是对作出(或者不作出)任何投资决定的建议,并且不能被用作任何上述行为的依据。历史数据和分析不应该作为对任何未来业绩分析、预测或者预计的指示或保证。MSCI 的信息是以“现状”的基础提供的,信息使用者需自行承担所有由使用该信息所带来的一切风险。MSCI 及每一个 MSCI 的关联机构,以及其他涉及或参与编制、计算或创建任何 MSCI 信息相关的每一个个人(合称“MSCI 方”),均明示免除与此信息相关的所有保证(包括但不限于原创性、准确性、完整性、及时性、非侵权性、适销性以及适用于特定用途的任何保证)。在不限制上述任何规定的原则下,在任何情况下,任何 MSCI 方不会对任何直接的、间接的、特殊的、附带的、惩罚性的、相应而生的(包括但不限于利润的损失)或其他任何的损害承担任何责任。(www.msci.com)

## 十、代理投票

1、基金管理人作为基金投资者的代理人，将行使股票的代理投票权。在代理投票时，公司将本着投资者利益最大化的原则，按照增加股东利益、提高股东发言权的原则提出代理投票的建议。

2、代理投票权的决定将由基金经理做出。基金管理人将保留代理投票的文件至少三年以上。

3、基金管理人可委托境外托管人进行代理投票。基金投资于注册地在中国以外的公司发行的和没有在中国证券交易所上市的有投票权的股票。国外的公司治理标准、法律或监管要求和披露实务操作与中国的相关规定存在差异。当委托投票权与非中国证券相关时，受托机构将考虑在相关外国市场上适用的不同的法律法规，提出决定如何行使表决权的建议。

4、在某些中国以外的法域中，就基金组合内公司的股份行使投票权的股东可能被限制在股东大会召开日期前后的一段时间内对股票进行交易。由于此类交易限制会妨碍组合管理且可能导致基金的流动性受损，如果存在此类限制，管理人在一般情况下将不行使代理投票权。此外，某些中国以外的法域要求投票的股东就不同的基金披露当前的持股情况，如果存在此类披露要求，管理人在一般情况下将不行使委托投票权，以保护基金持有信息。

5、基金管理人将保留委托投票权的记录，至少保存3年以上。其中包括：

(1) 基金作为证券持有人收到的有报告义务的发行人的证券持有人会议相关的材料；

(2) 发行人的名称；

(3) 组合证券的交易所代码；

(4) 会议日期；

(5) 会议上需投票的事项的简要描述；

(6) 需投票的事项是否由发行人、其管理层或其他人或公司提出；

(7) 基金是否对该等事项进行了投票；

(8) 基金如何就该等事项进行了投票；

(9) 基金的投票是赞成还是反对发行人的管理层的提议。

6、必要时，管理人也将聘请 ISS（美国专业从事代理投票顾问服务的公司

Institutional Shareholder Services) 等第三方提供代理投票服务, 协助进行代理投票的决定。第三方代理投票服务机构将提供代理投票的分析、提出投票建议, 并将管理人提出的投票决定形成指令通知发给统计投票机构, 按月出具持有股票的报告、投票的季度和年度总结。

## 十一、证券交易

1、券商的交易执行能力、研究实力和提供的研究服务, 这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准, 包括以下几个方面:

交易执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有: 是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响等;

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告, 报告内容是否详实, 投资建议是否准确;

提供研究服务的质量。主要指券商承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座。

2、管理人根据上述标准对境外券商进行遴选, 拟定交易量分仓比例, 并每季度进行调整。

考核内容包括: 服务质量、证券推荐的成功率、交易的执行力等因素。

考核采取打分制, 打分采取加权平均的办法, 主要有以下方面: 交易执行能力(40%)、研究能力(30%)、服务质量(30%)。

3、每家券商的分仓比例上限为 50%, 具体分仓计算公式为:  $50\% \times \text{考核得分} / 5$ 。

4、对于在券商选择和分仓中存在或潜在的利益冲突, 管理人应该本着维护持有人的利益出发进行妥善处理, 并及时进行披露。

5、交易佣金的返还。管理人每年年初根据对券商的评价和考核, 与券商签订服务协议, 在协议中规定详细的交易佣金的收取标准, 严格禁止佣金返还的情况出现。

## 十二、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。

### 十三、投资组合报告

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23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2024年07月01日起至2024年09月30日止。

## 投资组合报告

### 1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	320,837,909.75	89.30
	其中：普通股	320,837,909.75	89.30
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	38,127,016.22	10.61
8	其他资产	327,355.18	0.09
9	合计	359,292,281.15	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 1,564,944.09 元，占期末净值比例为 0.44%。

### 1.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	320,837,909.75	90.81
合计	320,837,909.75	90.81

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 1.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	808.00	0.00
20 工业	-	-
25 可选消费	2,054,219.27	0.58
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	318,023,250.65	90.01
40 金融	235,331.12	0.07
45 信息技术	-	-

50 电信服务	524,300.71	0.15
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	320,837,909.75	90.81

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

**1.4 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及存托凭证投资明细**

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Keymed Biosciences Inc	康诺亚生物医药科技有限公司	2162 HK	香港联合交易所	中国香港	976,000	36,702,131.57	10.39
2	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	翰森制药集团有限公司	3692 HK	香港联合交易所	中国香港	1,806,000	34,119,855.90	9.66
3	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical	四川科伦博泰	6990 HK	香港联	中国香港	203,500	33,748,273.33	9.55

	Co Ltd	生物 医药 股份 有限 公司		合 交 易 所				
4	HUTCHMED China Ltd	和黄 医药 (中 国) 有限 公司	13 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,139,000	33,073,869.68	9.36
5	Innovent Biologics Inc	信达 生物 制药	1801 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	773,000	32,832,640.86	9.29
6	Remegen Co Ltd	荣昌 生物 制药 (烟 台) 股份 有限 公司	9995 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,601,500	24,696,105.31	6.99
7	BeiGene Ltd	百济 神州	6160 HK	香 港	中 国 香 港	165,500	21,595,931.65	6.11



		有限公司		联合交易所				
8	Akeso Inc	康方生物科技（开曼）有限公司	9926 HK	香港联合交易所	中国香港	349,000	21,590,115.10	6.11
9	InnoCare Pharma Ltd	诺诚健华医药有限公司	9969 HK	香港联合交易所	中国香港	3,350,000	20,361,516.41	5.76
10	Abbisko Cayman Ltd	和誉开曼有限责任公司	2256 HK	香港联合交易所	中国香港	2,667,000	9,283,585.37	2.63

### 1.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**1.9 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基金投资明细**

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

**1.10 投资组合报告附注**

**1.10.1**

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**1.10.2**

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。

**1.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	327,355.18
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	327,355.18
---	----	------------

#### 1.10.4 报告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。

#### 1.10.5 报告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。

## 五、 基金的业绩

一、本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准（GIPS）

- 1、在业绩表述中采用统一的货币；
- 2、按照 GIPS 的相关规定和标准进行计算；
- 3、如果 GIPS 的标准与国内现行要求不符时，同时公布不同标准下的计算结果，并说明其差异；
- 4、对外披露时，需要注明业绩计算标准是符合 GIPS 要求的。

二、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。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

汇添富香港优势精选混合（QDII）A

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)
2014年1月17日(基 金合同生效日)至 2014年12月31日	-1.50%	0.80%	6.51%	0.89%	-8.01%	-0.09%
2015年1月1日至 2015年12月31日	-3.43%	1.43%	-2.50%	1.47%	-0.93%	-0.04%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-6.01%	1.15%	-1.28%	1.14%	-4.73%	0.01%
2017年1月1日至 2017年12月31日	32.08%	0.84%	45.90%	0.74%	-13.82%	0.10%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-24.41%	1.54%	-18.16%	1.34%	-6.25%	0.20%
2019年1月1日至 2019年12月31日	17.19%	0.93%	17.84%	1.00%	-0.65%	-0.07%
2020年1月1日至 2020年12月31日	31.52%	1.84%	22.58%	1.56%	8.94%	0.28%
2021年1月1日至 2021年12月31日	-30.90%	1.92%	-20.49%	1.42%	-10.41%	0.50%
2022年1月1日至 2022年12月31日	-8.18%	2.22%	-21.17%	2.17%	12.99%	0.05%
2023年1月1日至	-19.95%	2.01%	-14.05%	1.37%	-5.90%	0.64%

2023年12月31日						
2024年1月1日至 2024年9月30日	-0.45%	2.23%	23.10%	1.44%	-23.55%	0.79%
2014年1月17日(基 金合同生效日)至 2024年9月30日	-30.43%	1.61%	10.49%	1.37%	-40.92%	0.24%

汇添富香港优势精选混合(QDII)C

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)
2023年2月7日(基 金增设份额日)至 2023年12月31日	-27.07%	1.97%	-20.51%	1.36%	-6.56%	0.61%
2024年1月1日至 2024年9月30日	-0.89%	2.21%	23.10%	1.44%	-23.99%	0.77%
2023年2月7日(基 金增设份额日)至 2024年9月30	-27.72%	2.08%	-2.15%	1.40%	-25.57%	0.68%

2、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

汇添富香港优势精选混合(QDII)A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富香港优势精选混合（QDII）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



## 六、 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，上海资产管理协会会长，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。

李芸女士，2023年8月22日起担任董事。中国籍，1964年出生，华东师范大学经济学硕士，高级编辑。现任上海报业集团党委书记、社长。历任上海第四师范学校团委书记、教师；共青团卢湾区委学校部副部长、部长、副书记，卢湾区妇女联合会副主任，卢湾区委办公室副主任，卢湾区五里桥街道党工委书记，卢湾区委常委、宣传部部长；闵行区委常委、宣传部部长；解放日报报业集团党委副书记、纪委书记，解放日报党委书记；上海报业集团党委副书记，解放日报社党委书记、社长。其他现任职务包括全国第十四届政协委员，中共上海市第十一届、第十二届委员会委员，中国报业协会副理事长，上海众源资本管理有限公司董事长，东方证券股份有限公司董事。

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（SHANG JIN WEI）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、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。现任中国首席经济学家论坛理事长、中国金融论坛创始成员、上海市经济学会副会长、华东师范大学经济与管理学部名誉主任、复旦大学管理学院特聘教授、上海交通大学上海高级金融学院兼职教授、上海首席经济学家金融发展中心理事长。曾任中国金融40人论坛常务理事和特邀成员、中国银行业协会行业发展研究委员会主任，2007-2019任交通银行首席经济学家，多次出席党和国家领导人主持的专家会议，多次担任上海市人民政府决策咨询特聘专家，享受国务院政府特殊津贴。

## 2、监事会成员

毛海东先生，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，上海财经大学经济学硕士。现任东航私募基金管理有限公司总经理、董事长，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，汇添富基金管理股份有限公司监事。曾任东航期货有限责任公司总经理、董事长、党总支部书记，东航金控有限责任公司财富管理中心总经理、总经理助理，曾任职于东航集团财务有限责任公司等。

王如富先生，2015年9月8日起担任监事。中国籍，1973年出生，浙江大学硕士研究生，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。

邹捷先生，2023年8月22日起担任监事。中国籍，1970年出生，复旦大学

会计专业硕士，高级会计师。现任上海报业集团资产运营部主任。历任上海焦化总厂财务处职员，中国华源集团有限公司财务部职员，中国华源集团有限公司驻英国办事处总经理助理，中国华源集团有限公司机电进出口事业部财务经理，中国华源集团生命产业有限公司医疗健康事业部财务副处长，上海华源热疗技术有限公司财务经理，解放日报报业集团计划财务处处长助理，解放日报报业集团计划财务处副处长，解放日报报业集团计划财务处处长，上海报业集团财务管理部常务副主任。

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私人财富管理中心总监。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。中国籍，1971年出生，工商管理硕士。2011年12月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理、市场总监。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。

娄焱女士，2013年1月7日起担任副总经理。中国籍，1971年出生，金融经济学硕士。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。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。

袁建军先生，2015年8月5日起担任副总经理。中国籍，1972年出生，金融学硕士。2005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、投资决策委员会主席。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。

李骁先生，2017年3月3日起担任副总经理。中国籍，1969年出生，武汉大学金融学硕士。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理、首席信息官。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）。

李鹏先生，2015年6月25日起担任督察长。中国籍，1978年出生，上海财经大学经济学博士。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司督察长。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部总监。

#### 4、基金经理

##### （1）现任基金经理

张韡，国籍：中国。学历：康奈尔大学生物医学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任东方证券医药助理研究员，汇添富基金医药研究员、高级医药研究员及医药行业研究组组长。2021年3月25日至今任汇添富健康生活一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至今任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2022年10月21日至今任汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2023年11月23日至今任汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2023年11月23日至今任汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金的基金经理。

##### （2）历任基金经理

刘子龙，2010年6月25日至2012年11月1日任汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金的基金经理。

王致人，2010年6月25日至2015年6月15日任汇添富香港优势精选混合

型证券投资基金的基金经理。

赖中立，2015年5月26日至2016年7月13日任汇添富香港优势混合基金的基金经理。

倪健，2015年10月27日至2019年1月1日任汇添富香港优势混合基金的基金经理。

杨威风，2019年1月1日至2021年9月29日任汇添富香港优势精选混合型证券投资基金的基金经理。

陈健玮，2021年9月29日至2024年4月17日任汇添富香港优势精选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：邵佳民（首席固收投资官）、王栩（总经理助理，权益投资总监）、刘伟林（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权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；

（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；

（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。

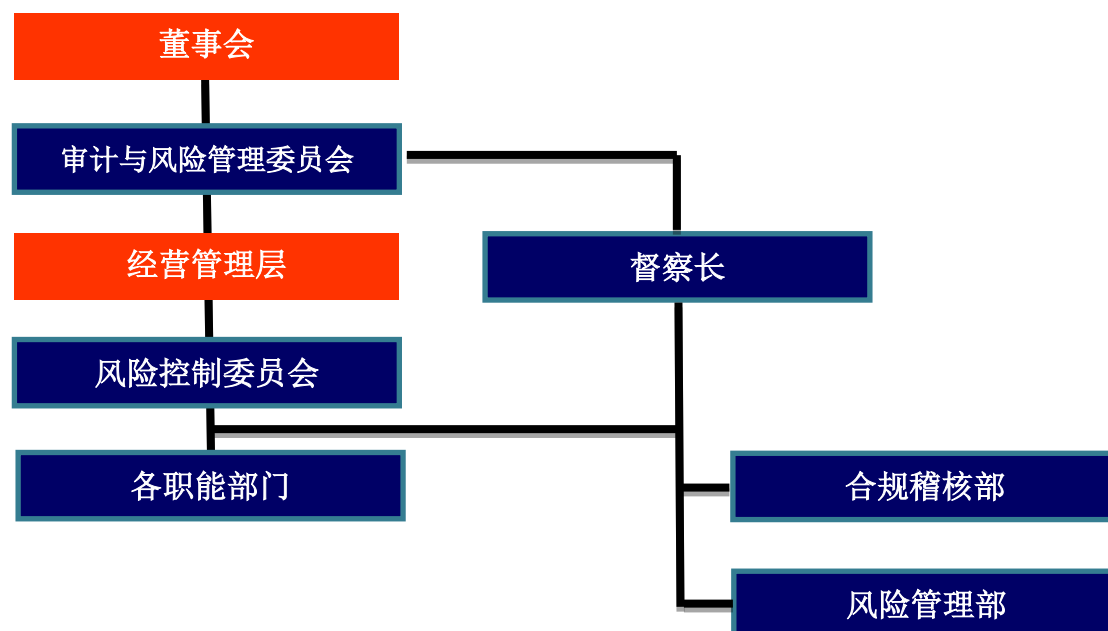
(5) 建立和推进员工职业守则教育和专业培训体系，确保员工具备良好的职业操守和充分的职责胜任能力。

(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度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》、《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基金托管人双人同步独立核算、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。

## 七、 基金的历史沿革

汇添富香港优势精选混合型证券投资基金由汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金更名而来。

汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金成立于2010年6月25日，基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

2014年1月8日，汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了关于修改基金名称及投资细节的议案。在基金管理人向中国证监会履行相应备案手续，并经中国证监会书面确认后，基金份额持有人大会决议生效。依据基金份额持有人大会决议，自中国证监会书面确认之日起，原《汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金合同》失效，《汇添富香港优势精选股票型证券投资基金基金合同》生效，基金更名为“汇添富香港优势精选股票型证券投资基金”，同时基金投资目标、投资范围等投资细节相应调整。

## 八、 基金的存续

### 一、基金份额的变更登记

《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》生效后，基金管理人负责办理基金份额的变更登记。基金管理人根据生效日的基金份额持有人名册，进行基金份额更名以及必要的信息变更，并对投资者持有的基金份额予以确认或重新登记。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 九、 基金份额的申购和赎回

### 一、 申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的基金代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、 申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》生效后即可开始办理。在汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议予以合法披露的同时，基金管理人应公告开始办理申购赎回的具体日期。

申购和赎回的开放日为上海和深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日的开放时间（开放时间详见相关公告或《招募说明书》的规定）办理申购和赎回申请。如遇国内的节假日则顺延至下一开放日。当香港证券市场节假日休市或遇其他不可抗力时，基金管理人可以暂停申购或赎回。基金管理人可与销售机构约定，在开放日的其他时间受理投资者的申购、赎回申请，但是对于投资者在非开放时间提出的申购、赎回申请，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基金份额的价格。

若出现新的交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但必须在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

本基金 A 类基金份额于 2014 年 1 月 17 日开始办理日常申购、赎回业务。  
本基金 C 类基金份额于 2023 年 2 月 7 日开始办理日常申购、赎回业务。

### 三、 申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、先进先出原则，即基金份额持有人在赎回基金份额，基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，认购、申购确认日期在前的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### 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基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的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，基金管理人在T+2日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+3日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

##### 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，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+10日内将赎回款项划往基金份额持有人账户，但中国证监会另有规定除外。国家外汇管理相关规定有变更或本基金所投资市场的交易清算规则有变更时，赎回款支付时间将相应调整。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

#### 五、申购与赎回的数额限制

1、投资者通过基金管理人直销中心首次申购本基金A类、C类基金份额的最低金额为人民币50000元（含申购费）；通过基金管理人线上直销系统申购本

基金 A 类、C 类基金份额单笔最低金额为人民币 1 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 类基金份额单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）。超过最低申购金额的部分不设金额级差。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2、投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回最低份额 0.1 份，基金份额持有人在销售机构保留的基金份额不足 0.1 份的，登记系统有权将全部剩余份额自动赎回。

3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。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设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购费用和赎回费用

1、本基金 C 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，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。赎回费用由基金赎回人承担。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

3、本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。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。

4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》及基金产品资料概要中列示。

### （1）申购费率



本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

本基金 A 类基金份额申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
M<100 万元	1.20%
100 万元≤M<200 万元	0.80%
200 万元≤M<500 万元	0.30%
M≥500 万元	每笔 1000 元

## (2) 赎回费率

本基金各类基金份额采用不同的赎回费率结构，赎回费率具体如下：

1) 本基金 A 类基金份额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如下：

持有期限 (N)	赎回费率	归入基金资产比例
N<7 天	1.50%	100%
7 天≤N<1 年	0.50%	25%
1 年≤N<2 年	0.25%	25%
N≥2 年	0	--

注：1 年按 365 天计算。

2) 本基金 C 类基金份额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如下：

持有期限 (N)	赎回费率	归入基金资产比例
N<7 天	1.50%	100%
7 天≤N<30 天	0.50%	100%
N≥30 天	0	--

基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资

者以及以特定交易方式等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、本基金申购份额的计算：

本基金采用金额申购的方式。C类基金份额不收取申购费，A类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。

(1) A类基金份额的计算具体如下：

申购费用适用比例费率时：

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

申购费用适用固定金额时：

申购费用 = 固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

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 =  $50,000 / (1+1.20\%) = 49,407.11$  元

申购费用 =  $50,000 - 49,407.11 = 592.89$  元

申购份额 =  $49,407.11 / 1.052 = 46,964.93$  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1.20%，假设申购当日A类基金份额净值为1.052元，则其可得到46,964.93份A类基金份额。

(2) C类基金份额的计算具体如下：

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 类基金份额净值为 1.052 元，则可得到 47,528.52 份 C 类基金份额。

## 2、本基金赎回金额的计算：

本基金采用“份额赎回”方式。基金赎回金额具体的计算方法在如下：

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用，其中：

赎回总额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

净赎回金额=赎回总额-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 90 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：

赎回总额 =  $10,000 \times 1.052 = 10,520.00$  元

赎回费用 =  $10,520.00 \times 0.50\% = 52.60$  元

净赎回金额 =  $10,520.00 - 52.60 = 10,467.40$  元

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 90 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 10,467.40 元。

例：某投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 20 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.042 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总额 =  $10,000 \times 1.042 = 10,420.00$  元

赎回费用 =  $10,420.00 \times 0.50\% = 52.10$  元

净赎回金额 =  $10,420.00 - 52.10 = 10,367.90$  元

即：投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 20 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.042 元，则其可得到的净赎回金额为 10,367.90 元。

## 3、基金份额净值的计算：

各类基金份额净值应当在估值日后 2 个工作日内披露。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。本基金 A 类、C 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的基金份额净值为基准计算，上述涉及基金份额的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分按四舍五入方法计算；上述涉及金额的计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 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的基金份额净值为基准并扣除相应的费用，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

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述注册登记办理时间进行调整，并应当在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告，但不得实质影响投资者的合法权益。

### 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- 2、基金投资所处的主要市场休市时，具体规定参见《招募说明书》；
- 3、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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- 4、基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）；
- 5、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受投资人的申购申请；

7、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；

8、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；

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

发生上述情形之一的，申购款项将相应退还投资者。发生上述 1 到 4 项、第 6 项和第 9 项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停申购公告。

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，并依照有关规定在指定媒介公告。

#### **十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

1、不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

2、证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、基金投资所处的主要市场休市时，具体规定参见《招募说明书》；

5、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；

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比

例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在 20 个工作日内予以支付。

同时，在出现上述第 3 款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过支付时间 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公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请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% 时，即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本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投资者的全部赎回申请时，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投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日该类基金份额的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）如发生巨额赎回，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前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，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述比例约定的，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前述比例。

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。

（4）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 日内通过指定媒介或基金代销机构的网点刊登公告。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，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 个开放日的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人自行确定公告增加次数，并根据《信息披露办法》的规定在指定媒介刊登公告。

## 十三、基金的转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

## 十四、转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个

交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关  
规定以及基金代销机构的业务规则。

### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在  
届时发布公告或更新的《招募说明书》中确定。

本基金 A 类基金份额于 2014 年 1 月 17 日开始办理定期定额投资业务。本  
基金 C 类基金份额于 2023 年 2 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

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额  
按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可  
的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”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的情形；“司法执行”是指司法机关依据生  
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、社  
会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法  
规和《基金合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。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。

基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该  
项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

### 十七、基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻  
以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结  
部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。

### 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。



## 十、 基金的费用与税收

### 一、 基金费用的种类

- 1、 基金的管理费；
- 2、 基金的托管费，含境外托管人收取的费用；
- 3、 基金的销售服务费：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 6、 基金份额持有人大会费用；
- 7、 基金的证券交易费用；
- 8、 基金的证券结算费用；
- 9、 代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- 10、 基金的银行汇划费用；
- 11、 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 二、 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、 基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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 5 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、 基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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 5 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、公休日等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### **四、费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金赎回费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金赎回费率,须召开基金份额持有人大会审议,除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定;调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金赎回费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介公告。

#### **五、基金税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按相关国家或地区的税收法律、法规执行。

#### **六、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。

## 十一、基金的财产

### 一、基金资产总值

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

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、基金投资及收益以及估值调整；
- 7、股票投资及其估值调整；
- 8、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金根据相关法律法规开立基金资金账户以及证券账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金代销机构和基金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

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

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

基金管理人和基金托管人可将其义务委托第三方，并对第三方处理有关本基金事务的行为承担责任。

## 十二、基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 三、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、已上市流通的有价证券的估值

上市流通的股票和交易型开放式指数基金（ETF），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行的股票，按成本估值。

3、开放式基金的估值以其在估值日公布的净值进行估值，开放式基金未公布估值日的净值的，以估值日前最新的净值进行估值。

4、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

5、基金持有的其他有价证券，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的有价证券投资按估值日在证券交易所挂牌的该证券投资的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的其他有价证券投资按公允价估值；

6、在任何情况下，基金管理人如采用上述第 1-5 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。

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

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

9、估值中的汇率选取原则：

(1) 估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与主要货币的中间价。

(2) 其他货币采用美元作为中间货币进行换算，与美元的汇率则以估值日伦敦时间 16:00 彭博报价数据为准。

若无法取得上述汇率价格信息时，以托管银行中国工商银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### **四、估值对象**

本基金所拥有的各类有价证券。

#### **五、估值程序**

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以电子对账形式发给基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，并将复核结果返回给基金管理人；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。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

## 六、基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当基金估值出现影响某类基金份额净值的错误时,基金管理人应当立即纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;估值错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的,应先由基金管理人承担,基金管理人对其不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

关于差错处理,本合同的当事人按照以下约定处理:

### 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、或代理销售机构、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,过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、并不能克服的客观情况,按下列有关不可抗力的约定处理。

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(“受损方”),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,如果因基金管理人过错造成基金资产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金资产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失,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、行政法规、《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出现过错的当事人进行追索,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的交易数据的,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;

(5) 基金管理人及基金托管人某类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

## 七、暂停估值的情形

- 1、与基金投资有关的所有证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

## 八、特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 7 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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，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的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 九、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、 基金的收益与分配

### 一、 基金利润的构成

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

### 二、 基金可供分配利润

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

### 三、 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即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、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、 收益分配方案

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

### 五、 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

### 六、 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金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、 基金的会计与审计

### 一、 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。
- 8、基金管理人在会计年度结束后60个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

### 二、 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、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的年度财务报表进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

## 十五、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承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(一) 《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的3日前，将《招募说明书》、《基金合同》摘要登载在指定媒介；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。《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的事项的法律文件。

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。

## (二) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制《发售公告》，并在披露《招募说明书》的当日登载于指定媒介。

## (三) 《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒介登载《基金合同》生效公告。

## (四) 基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应

当至少每周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，基金管理人应当不晚于每个估值日后 2 个工作日，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后一个工作日的次日，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。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，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。

基金管理人应当在会计年度结束后 60 个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

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。

### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在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、境外托管人、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、基金托管人或境外托管人的法定名称、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百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体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。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，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 40 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。

#### （十）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。

#### （十一）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。

（十二）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的《招募说明书》、更新的基金产品资料概要、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

规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

**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。**

## 十六、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

#### （一）基金份额的申购与赎回

##### 1、侧袋账户

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

##### 2、主袋账户

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“基金份额的申购和赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

#### （二）基金的投资

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

### （三）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。

### （四）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。

### （五）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。

#### （六）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。

#### （七）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。

## 十七、 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、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：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高赎回费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、降低赎回费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》变更生效之日起2日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：



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

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### 四、清算费用

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

### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金

财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

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

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十八、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2024 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 211 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2024 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1428 只。自 2003 年以来，本行连续二十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 102 项最佳托管银行大奖；是获得

奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制情况

中国工商银行资产托管部在风险管理的实操过程中根据国际公认的内部控制 COSO 准则从内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、监督与评价五个方面构建起了托管业务内部风险控制体系，并纳入统一的风险管理体系。

中国工商银行资产托管部从成立之日起始终秉持规范运作的原则，将建立系统、高效的风险防范和控制体系视为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况的不断出现，资产托管部自始至终将风险管理置于与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存与发展的生命线。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和相关业务岗位，每位员工均有义务对自己岗位职责范围内的风险负责。从 2005 年至今，中国工商银行资产托管部共十七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告，充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。

##### 1. 内部控制目标

- （1）资产托管业务经营管理合法合规；
- （2）促进实现资产托管业务发展战略和经营目标；
- （3）资产托管业务风险管理的有效性和资产安全；
- （4）提高资产托管经营效率和效果；
- （5）业务记录、会计信息和其他经营管理相关信息的真实、准确、完整、及时。

##### 2. 内部控制的原则

- （1）全面性原则。资产托管业务内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖资产托管业务各项业务流程和管理活动，覆盖所有机构、部门和从业人员。
- （2）重要性原则。资产托管业务内部控制应在全面控制基础上，关注重要业务事项、重点业务环节和高风险领域。

(3) 制衡性原则。资产托管业务内部控制应在机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制，同时兼顾运营效率。

(4) 适应性原则。资产托管业务内部控制应当与经营规模、业务范围和风险特点相适应，并进行动态调整，以合理成本实现内部控制目标。

(5) 审慎性原则。资产托管业务内部控制应坚持风险为本、审慎经营的理念，设立机构或开展各项经营管理活动均应坚持内控优先。

(6) 成本效益原则。资产托管业务内部控制应权衡实施成本与预期效益，以合理成本实现有效控制。

### 3. 内部控制组织结构

资产托管业务内部控制纳入全行统一的内部控制体系。

(1) 总行资产托管部根据内部控制基本规定建立健全资产托管业务内部控制体系，作为全行托管业务的牵头管理部门，根据行内内部控制基本规定建立健全内部控制体系，建立与托管业务条线相适应的内部控制运行机制，确定各项业务活动的风险控制点，制定标准统一的业务制度；采取适当的控制措施，合理保证托管业务流程的经营效率和效果，组织开展资产托管业务内部控制措施的执行、监督和检查，督促各机构落实控制措施。

(2) 总行内控合规部负责指导托管业务的内控管理工作，根据年度工作重点，定期或不定期在全行开展相关业务监督检查，将托管业务检查项目整合到全行业务监督检查工作中，将全行托管业务纳入内控评价体系。

(3) 总行内部审计局负责对资产托管业务的审计与评价工作。

(4) 一级（直属）分行资产托管业务部门作为内部控制的执行机构，负责组织开展本机构内部控制的日常运行及自查工作，及时整改、纠正、处理存在的问题。

### 4. 内部控制措施

工商银行资产托管部重视内部控制制度的建设，坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中，建立了一整套内部控制制度体系，包括《资产托管业务管理规定》、《资产托管业务内部控制管理办法》、《资产托管业务全面风险管理办法》、《资产托管业务营运管理办法》、《资产托管业务合同管理办法》、《资产托管业务档案管理办法》、《资产托管业务系统管

理办法》、《资产托管业务重大突发事件应急预案》、《资产托管业务从业人员管理办法》等，在环境、制度、流程、岗位职责、人员、授权、创新、合同、印章、服务质量、收费、反洗钱、防止利益冲突、业务连续性、考核、信息系统等全方面执行内部控制措施。

#### 5. 风险控制

资产托管业务切实履行风险管理第一道防线的主体职责，按照“主动防、智能控、全面管”的管理思路，主动将资产托管业务的风险管理纳入全行全面风险管理体系，以“管住人、管住钱、管好防线、管好底线”为管理重点，搭建适应资产托管业务特点的风险管理架构，通过推进托管业务体制机制与完善集约化营运改革、建立资产托管风险管理委员会机制、完善资产托管业务制度体系、加强资产托管业务队伍建设、科技赋能、建立健全应急灾备体系、建立审计发现问题整改台账、加强人员管理等措施，有效控制操作风险、合规风险、声誉风险、信息科技风险和次生风险。

#### 6. 业务连续性保障

中国工商银行制订了完善的资产托管业务连续性工作计划和应急预案，具备行之有效的灾备恢复方案、充足的移动办公设备、同城异地相结合的备份办公场所、必要的工作人员、科学清晰的 AB 岗位设置及定期演练机制。在重大突发事件发生后，可根据突发事件的对托管业务连续性营运影响程度的评估，适时选择或依次启动“原场所现场+居家”、“部分同城异地+居家”、“部分异地异地+居家”、“异地全部切换”四种方案，由“总部+总行级营运中心+托管分部+境外营运机构”形成全球、全天候营运网络，向客户提供连续性服务，确保托管产品日常交易的及时清算和交割。

#### （五）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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 十九、 境外托管人

### 一、基本情况

名称： 布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）  
地址： 140 Broadway New York, NY 10005  
法定代表人： William B. Tyree (Managing Partner)  
组织形式： 合伙制（Partnership）  
存续期间： 持续经营

成立于1818年的布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）是全球领先的托管银行之一。BBH自1928年起已经开始在美国提供托管服务；1963年，BBH开始为客户提供全球托管服务，是首批开展全球托管业务的美国银行之一。BBH的惠誉长期评级为A+，短期评级为F1。

### 二、全球托管业务及主要人员情况

布朗兄弟哈里曼银行的全球托管业务隶属于本行的投资者服务部 (Investor Services)。在全球范围内，该部门由本行合伙人Seán Páircéir 先生领导。在亚洲，该部门由本行合伙人Noriyasu Sonobe先生领导。

作为一家全球化公司，BBH拥有服务全球跨境投资的专长，其全球托管网络覆盖近一百个市场。截至2022年12月31日，全球托管资产规模为4.3万亿美元，其中超过70%是跨境投资资产。亚洲是BBH业务增长最快的地区之一，我们投身于亚洲市场迄今已逾30年，亚洲区服务的资产超8,000亿美元。

投资者服务部是公司最大的业务部门，拥有近4,800名员工。我们致力为客户提供稳定优质的服务，并根据客户具体需求提供定制化的全面解决方案，真正做到“以客户为中心”。



由于坚持长期提供优质稳定的客户服务，BBH 多年来在行业评比中屡获殊荣，包括：



《全球托管人》

**2017年 行业领袖杰出奖**

获奖者-编辑选择奖：次托管服务-北美  
获奖者-共同基金管理 过户代理-北美

**2016年 行业领袖杰出奖**

获奖者-共同基金管理 托管服务-北美

**2015年 共同基金行政管理调查**

被评为“全球卓越者”

**2015年行业领袖杰出奖**

获奖者-共同基金管理 客户服务-北美

**2014年 代理银行调查**

#1 - 美国代理银行提供的资产服务

**2017 Industry Leaders Awards**

Editor's Choice Awards: North American Sub-Custody  
Mutual Fund Administration (North American clients):  
Transfer Agency

**2016 Industry Leaders Awards**

Mutual Fund Administration Custody Services: North  
America

**2015 Mutual Fund Administration  
Survey**

Rated 'Global Outperformer'

**2015 Industry Leaders Awards**

Mutual Fund Administration Client Service: North  
America

**2014 Agent Bank Survey**

#1 - Asset Servicing among US Agent Banks



《全球投资人》

**2016年 全球托管银行调查**

#1 - 共同基金/UCITS - 美洲地区(原始分数)  
#2 - 使用多个托管人的客户 - 欧洲、中东和非洲地区 (加权分数)

**2015年 全球托管银行调查**

#1 - 使用多个托管人的客户 - 亚太地区 (加权分数)  
#2 - 共同基金管理者 (全球和仅美洲地区)

**2014年 全球托管银行调查**

#1 - 资产管理规模超过30亿美元的客户 - 全球  
#1 - 资产管理规模超过30亿美元的客户 - 欧洲、中东和非洲  
#1 - 美洲共同基金管理人

**2016 Global Custody Survey**

#1 Mutual funds/UCITS - Americas (raw score)  
#2 Clients Using Multiple Custodians - EMEA (weighted scores)

**2015 Global Custody Survey**

#1 Clients using multiple custodians - Asia Pacific (weighted )  
#2 - Mutual Fund Managers (Global and Americas-only)

**2014 Global Custody Survey**

#1 Clients with AuM over \$3 billion - Global  
#1 Clients with AuM over \$3 billion - EMEA  
#1 Americas Mutual Fund Managers



《ETF Express》

**2018年ETF Express 大奖**  
最佳欧洲ETF基金行政管理人

**2017年ETF Express 大奖**  
最佳北美ETF基金行政管理人

**2016年ETF Express 大奖**  
最佳欧洲ETF基金行政管理人

**2014年ETF Express 大奖**  
最佳北美ETF基金行政管理人

**2018 ETF Express Awards**  
Best European ETF Fund Administrator

**2017 ETF Express Awards**  
Best North American ETF Fund Administrator

**2016 ETF Express Awards**  
Best European ETF Fund Administrator

**2014 ETF Express Awards**  
Best North American ETF Fund Administrator



**2014年 Global Custody.net 全球托管银行调查**  
#1 – 美洲

**2014 Global Custody.net Global Custody Survey**  
#1 Americas

**Coalition Greenwich 2022:**

**Ranked #1 for client service in FX**



2018 年度 ETF 托管行

2018 ETF Custodian of the Year



'The Asset's' 2019 亚洲 ETF AAA 奖  
最佳托管银行 - Rising Star, 香港

The Asset's Triple A Asia ETF Awards 2019  
Best Custodian - Rising Star, Hong Kong



'The Asset's' 2020、2021 亚洲 ETF AAA 奖  
香港最佳 ETF 托管银行

The Asset's Triple A Asia ETF Awards 2020 & 2021  
Best ETF Custodian for Hong Kong

### 三、境外托管人的职责

- 1、 安全保管受托财产；
- 2、 计算境外受托资产的资产净值；
- 3、 按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、 按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- 5、 按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- 6、 保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
- 7、 其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 二十、 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）

网址：[www.99fund.com](http://www.99fund.com)

邮箱：[guitai@htffund.com](mailto:guitai@htffund.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：

本基金的代销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：马树超

### 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

## 二十一、 基金合同的内容摘要

### 〈一〉 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法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、基金销售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、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）遵守《基金合同》；
- （2）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （3）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （4）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；

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金代销机构处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集基金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率、托管费率和赎回费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(13) 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；

(14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(16) 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；

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

(1) 依法募集基金，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；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(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分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购和赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露

及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时足额向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能



生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4) 选择、更换或撤销境外托管人；

(5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(6) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(7) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(8) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人固有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，

保证不同基金之间在名册登记、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，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益；

(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，按照有关法律法规和《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(8) 确保基金份额净值按照有关法律法规、基金合同规定的方法进行计算，复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(15) 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；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；

(23) 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

(24) 安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

(25) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(26) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(27) 保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(28) 法律法规、《基金合同》规定的其他义务以及中国证监会和外管局根据审慎监管原则规定的基金托管人的其他职责。

## **<二> 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

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

### **一、召开事由**

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

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

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和本基金合同规定的范围内，以及在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整本基金 A 类基金份额的申购费率、调低 C 类基金份额的销售服务费率、调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别的设置；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以

外的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

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

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

## 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

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

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话

或其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行；基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用纸质、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。



## （2）通讯开会

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

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 七、计票

### 1、现场开会

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

后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### 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> 基金收益分配原则、执行方式

#### 一、基金利润的构成

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

## 二、基金可供分配利润

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

## 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 25%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即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、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 四、收益分配方案

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

## 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

## 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金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，详见招募说明书的规定。

#### <四> 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 一、基金费用的种类

- 1、基金的管理费；
- 2、基金的托管费，含境外托管人收取的费用；
- 3、基金的销售服务费：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的证券结算费用；
- 9、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

##### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

###### 2、基金的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师

费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金赎回费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金赎回费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率、基金赎回费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按相关国家或地区的税收法律、法规执行。

#### 六、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，详见招募说明书的规定。

### <五> 基金财产的投资方向和投资限制

#### 一、投资目标

在香港证券市场精选具有持续竞争优势且估值有吸引力的公司股票等证券，通过有效的资产配置和组合管理，进行中长期投资布局，在有效管理风险的前提下，追求持续稳健的较高投资回报。

#### 二、投资范围

本基金投资范围为香港证券市场公开上市的股票、固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构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，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于股票的基金资产占基金资产总值的比例为

60%-95%；其余基金资产投资于固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为5%-40%，其中基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券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。

在有关法律法规发生变动时，本基金资产配置比例等应作相应调整。

### 三、投资限制

#### （一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、购买不动产；
- 5、购买房地产抵押按揭；
- 6、购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- 7、购买实物商品；
- 8、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- 9、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- 10、参与未持有基础资产的卖空交易；
- 11、购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- 12、直接投资与实物商品相关的衍生品；
- 13、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 14、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### （二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：



1、基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

2、基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。

3、不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

4、基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

5、基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

6、基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

7、本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金资产净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制。

8、同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

9、为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

10、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。

若基金超过上述 1-9 项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

### （三）金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放

大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1、本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2、本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3、本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

(3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4、基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

(四) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2、应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3、借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4、除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

(1) 现金；

(2) 存款证明；

(3) 商业票据；

(4) 政府债券；

(5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5、本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限

内要求归还任一或所有已借出的证券。

6、基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(五) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2、参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3、买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4、参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5、基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(六) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

## **<六> 基金资产净值的计算方法和公告方式**

### **一、计算方法**

本基金按以下方式进行估值：

#### **1、已上市流通的有价证券的估值**

上市流通的股票和交易型开放式指数基金（ETF），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行的股票，按成本估值。

3、开放式基金的估值以其在估值日公布的净值进行估值，开放式基金未公布估值日的净值的，以估值日前最新的净值进行估值。

4、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

5、基金持有的其他有价证券，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的有价证券投资按估值日在证券交易所挂牌的该证券投资的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的其他有价证券投资按公允价估值；

6、在任何情况下，基金管理人如采用上述第 1-5 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。

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

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

9、估值中的汇率选取原则：

(1) 估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与主要货币的中间价。

(2) 其他货币采用美元作为中间货币进行换算，与美元的汇率则以估值日伦敦时间 16:00 彭博报价数据为准。

若无法取得上述汇率价格信息时，以托管银行中国工商银行或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经

相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 二、公告方式

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；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。

《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，基金管理人应当不晚于每个估值日后2个工作日，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后一个工作日的次日，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。

## <七> 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### 一、《基金合同》的变更

1、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：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准、提高销售服务费率和提高赎回费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在《基金合同》规定的范围内变更本基金的 A 类基金份额申购费率、降低赎回费率和 C 类基金份额的销售服务费率；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》变更生效之日起 2 日内在指定媒介公告。

## 二、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

## 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、

估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

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

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### <八> 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当

时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### **<九> 基金合同存放地和投资者取得合同的方式**

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。



## 二十二、 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

法定代表人：李文

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]5 号

注册资本：人民币 132,724,224 元

组织形式：股份有限公司

经营范围：基金募集，基金销售，资产管理，经中国证监会许可的其他业务（企业经营涉及行政许可的，凭许可证件经营）

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、国内外结算、办理票据承兑、贴现、转贴现、国内会计业务、代理资金清算、提供信用证服务，代理销售业务，代理发

行、代理承销、代理承兑债券，代收代付业务，代理证券资金清算业务，保险业代理业务，代理外国银行和国际金融机构贷款业务，证券投资基金、企业年金托管业务、企业年金账户管理服务、认购申购业务，咨询调查业务，贷款承诺、企业个人财务顾问服务、组织或参加银行贷款外汇存款，外汇贷款，外币兑换，出口托收及进口代收，外汇票据承兑和贴现，外汇借款、外汇担保、发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外汇有价证券。自营代外汇买卖，外汇金融衍生业务，银行卡业务，电话银行、网上银行，手机银行业务，办理结汇售汇业务，经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## <二> 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资范围为香港证券市场公开上市的股票、固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构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，可以将其纳入投资范围，经托管人确认后，纳入监督范围。

本基金不得投资于相关法律法规及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

投资于股票的基金资产占基金资产总值的比例为 60%-95%；其余基金资产投资于固定收益产品、基金、货币市场工具以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为 5%-40%，其中基金持有的现金和到期日在一年以内的政府债券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。

在有关法律法规发生变动时，本基金资产配置比例等应作相应调整。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规

定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

2) 基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。

3) 基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

4) 基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一基金管理人管理的且由本协议托管人托管的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

5) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

6) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金资产净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制。

7) 同一基金管理人管理且由本协议托管人托管的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

8) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

9) 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。

若基金超过上述 1) - 8) 项投资比例限制, 应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

10) 本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理, 不得用于投机或放大交易, 同时应当严格遵守下列规定:

A. 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

B. 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

C. 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品, 应当符合以下要求:

a. 所有参与交易的对手方 (中资商业银行除外) 应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

b. 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值, 并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

c. 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

D. 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

11) 本基金可以参与证券借贷交易, 并且应当遵守下列规定:

A. 所有参与交易的对手方 (中资商业银行除外) 应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

B. 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

C. 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

D. 除中国证监会另有规定外, 担保物可以是以下金融工具或品种:

a. 现金;

b. 存款证明;

c. 商业票据;

d. 政府债券;

e. 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构 (作为交易对手方或其关联方的除外) 出具的不可撤销信用证。

E.本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

F.基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任

12) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易, 并且应当遵守下列规定:

A.所有参与正回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

B.参与正回购交易, 应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

C.买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

D.参与逆回购交易, 应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

E.基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

13) 基金参与证券借贷交易、正回购交易, 所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算, 基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的, 履行适当程序后, 基金不受上述限制。

除投资资产配置外, 基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

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。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金禁止从事下列行为:

(1) 承销证券;

- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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，若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。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

## 5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金投资银行存款的，其基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。本基金投资除提供的存款银行名单以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于存款银行名单进行调整。

（二）基金托管人应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。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作和投资指令违反法律法规或《基金合同》的规定，应及时以书面或电话或双方认可的其他方式通知基金管理人，由基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正，基金托管人应报告监管部门。

基金托管人发现基金管理人或其授权投资机构有重大违法违规行为，应立即报告有关监管机构，同时通知基金管理人；由基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告有关监管机构。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，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，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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。

(四) 基金管理人认可, 基金托管人及其境外托管人的合规监管系统的准确性和完整性受限于基金管理人、经纪人及其他中介机构提供用于该系统的数据和信息, 合规投资责任方为基金管理人。基金托管人及其境外托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示, 并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

#### (五) 无投资责任

基金管理人应理解, 托管人对于基金管理人的交易监督服务是一种加工应用信息的服务, 而非投资服务。除下列第(六)项外, 基金托管人及其境外托管人将不会因为提供交易监督服务而承担任何因基金管理人违规投资所产生的有关责任, 也没有义务去采取任何手段回应任何与合规分析服务有关的信息和报道, 除非接到基金管理人或其授权机构要求基金托管人或其境外托管人针对某个信息和报道作回应的书面指示。

(六) 基金托管人及其境外托管人应本着诚实尽责的原则, 采取合理的手段、方法和实施工具, 来提高交易监督服务的质量, 除非基金托管人或其境外托管人因疏忽、过失或故意而未能尽职尽责, 造成交易监督结果不准确, 并进而给基金管理人造成损失, 否则基金托管人或其境外托管人不应就交易监督服务承担任何责任。

### <三> 基金管理人 对基金托管人的业务核查

(一) 在本协议有效期内, 在不违反公平、合理原则, 以及不导致基金托管人的接受基金管理人监督与检查与相关法律法规及其行业监管要求相冲突的基础上, 基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的监督与检查。基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括但不限于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、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时, 基金管理人须向基金托管人作出书面提示; 基金托管人在接到提示后, 应立即对提示内容予以



确认，如无异议，应在基金管理人给定的合理期限内改进，如有异议，应作出书面解释。

（三）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。

#### <四> 基金财产保管

##### （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；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；
- 3、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；
- 4、除依据有关法律法规规定和本协议约定外，基金托管人、及其境外托管人不得利用基金财产为自己或第三方谋取利益，违反此义务所得利益归于基金财产，由此造成的直接损失由基金托管人承担，该等责任包括但不限于恢复基金财产的原状、承担因此所引起的直接损失的赔偿责任；
- 5、基金托管人自身，并尽商业上的合理努力确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券；
- 6、除非根据基金管理人书面同意，基金托管人和境外托管人不得在任何托管资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等，基金托管人将尽商业上的合理努力确保境外托管人不得在任何托管资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等；
- 7、对于因为基金管理人进行本协议项下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。到账日没有到达托管账户的，基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期满，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，由基金管理人聘请具有从事

证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

2、验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

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事宜。

### （三）资产保管内容和约定事项

基金管理人同意，现金账户中的现金将由基金托管人或其境外托管人以基金托管人或其境外托管人的银行身份持有。

除非授权人士按指令程序发送的指令另有规定，否则，基金托管人和其境外托管人应在收到授权人士的指令后，按下述方式支付现金、售出或交付证券：(1) 按照交易发生的司法管辖区或市场的有关惯常和既定惯例和程序作出；或(2)就通过证券系统进行的买卖而言，按照管辖该系统运营的规则、条例和条件作出。基金托管人和其境外托管人应不时将该等有关惯例、程序、规则、条例和条件及时通知基金管理人。

基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产或破产等原因进行终止清算时，不得将基金财产归入其清算财产，境外托管人所在地法律或监管机构另有规定的除外。

基金托管人应自身，并尽商业的合理努力确保其境外托管人建立安全的数据管理机制，安全完整地保存基金管理人与基金财产相关的业务数据和信息。

### （四）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金、基金托管人或基金托管人与境外托管人联名的名义在其营业机构或其境外托管人开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。基金的银行预留印鉴由基金托管人或其境外托管人的营业机构保管和使用。

2、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借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基金业务以外的活动。

3、基金资金账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区相关监管机构的有关规定。

#### （五）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在基金所投资市场或证券交易所适用的登记结算机构为基金开立以基金名义或基金托管人名义或其境外托管人名义或境外托管人的代理人的名义或以上任何一方与基金联名名义的证券账户。由基金托管人或其境外托管人负责办理与开立证券账户有关的手续。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及各自境外托管人均不得出借或未经基金托管人、基金管理人双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基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件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。

4、基金管理人投资于合法合规、符合基金合同的其他非交易所市场的投资品种时，在基金合同生效后，基金托管人或其境外托管人根据投资所在市场以及国家或地区的相关规定，开立进行基金的投资活动所需要的各类证券和结算账户。

5、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区有关法律的规定。

#### （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，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或其境外托管人负责开立，基金管理人应提供所有必要协助。

2、投资市场所在国家或地区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）证券登记

1、境外证券的注册登记方式应符合投资当地市场的有关法律、法规和市场惯例。

2、基金托管人应确保基金管理人所管理的基金或基金份额持有人始终是所

有证券的实益所有人(beneficial owner)的方式持有基金财产中的所有证券。

3、基金托管人应该：(1)在其帐目和记录中单独列记属于本基金的证券，并且(2)要求尽商业上的合理努力确保其境外托管人在其各自帐目和记录中单独清楚列记证券不属于境外托管人，不论证券以何人的名义登记。而且，若证券由基金托管人、境外托管人以无记名方式实际持有，要求和确保其境外托管人将这些证券和基金托管人、其境外托管人自有的资产、任何其他人的资产分别独立存放。

4、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。

5、存放在证券系统的证券应按照基金托管人及其境外托管人的指示为基金的实益所有人持有，但须遵守管辖该系统运营的规则、条例和条件。

6、由基金托管人及其境外托管人为基金的利益而持有的证券(无记名证券和在证券系统持有的证券除外)应按本协议约定登记。

7、基金托管人及其委托应就其为基金管理人利益而持有证券的市场有关证券登记方式的重大改变通知基金管理人，并应基金管理人要求将这些市场发生的事件或惯例变化通知基金管理人。若基金管理人要求改变本协议约定的证券登记方式，基金托管人及其委托应就此予以充分配合。

（八）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价值凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人及其境外托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人及其境外托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人及其境外托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人及其境外托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（九）与基金财产有关的重大合同的保管

基金管理人应及时向基金托管人提供涉及基金财产投资运作的书面协议的副本。

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应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，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。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门，保存时间应符合相关法律、法规要求。

#### <五> 基金资产净值计算和会计核算

##### （一）基金资产估值方法和特殊情形的处理

##### 1、会计核算和估值的处理原则

（1）基金资产的会计责任主体为基金管理人，基金管理人应根据与基金托管人协商确定的会计原则和核算方法进行会计处理。监管部门或行业组织另有约定的从其约定。基金托管人应根据与基金管理人协商确定的会计原则和核算方法对本基金进行会计处理、对资产净值计算进行复核。基金管理人在保证信息准确性的前提下应向基金托管人提供基金托管人进行本基金的净值计算的复核和本基金进行信息披露所需要的相关信息。基金管理人应依据与基金托管人协商确定的会计原则和会计准则进行会计处理。监管部门或行业组织另有约定的，从其约定。

基金托管人、境外托管人应按国家规定和基金管理人要求对基金资产中的证券账户和现金账户进行帐实核对。

（2）基金管理人有权委托第三方独立机构进行会计核算，并认可其委托的第三方独立机构所计算的基金资产净值，基金托管人对基金管理人认可的第三方独立机构所计算的资产净值进行复核。

##### 2、基金托管人的会计核算处理

（1）在遵守相关会计法律法规的前提下，基金托管人应按基金管理人和基金托管人协商确定的会计核算方法和处理原则进行会计核算，并对基金财产单独建账、独立核算，并应指定专门人员负责会计核算与会计资料保管。属于基金财产的收入应全额计入会计账簿，不得与其他托管资产的收入相混淆。

（2）基金资产核算的内容包括但不限于：证券买卖业务的核算、持有资产的付息、兑付、分红等业务的核算、证券发行认购业务的核算、货币市场工具买卖业务的核算、银行存款计息、存款账户间的资金划付业务的核算、支付费用的核算、汇兑损益的核算等。

##### 3、净值计算

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。各类基金份额净值是指各类基金资产净值除以该类基金份额的份额总数, 各类基金份额净值的计算, 均精确到 0.001 人民币, 小数点后第 4 位四舍五入, 国家另有规定的, 从其规定。

(2) 基金资产净值的计算日为每一工作日, 基金管理人和基金托管人在收集净值计算日估值价格截止时点所估值证券的最近市场价格后, 对各类估值资产进行估值, 计算出基金资产净值及各类基金份额净值, 并按规定公告。

## (二) 基金份额净值错误的处理方式

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。当基金估值出现影响某类基金份额净值的错误时, 基金管理人应当立即纠正, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大; 估值错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告, 并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的, 应先由基金管理人承担, 基金管理人对其不应由其承担的责任, 有权向过错人追偿。

关于差错处理, 本合同的当事人按照以下约定处理:

### 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、或代理销售机构、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, 过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、并不能克服的客观情况, 按下列有关不可抗力的约定处理。

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（“受损方”），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，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，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、行政法规、《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出现过错的当事人进行追索，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的交易数据的，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；

(5) 基金管理人及基金托管人某类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### (三) 暂停估值的情形

1、与基金投资有关的所有证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、监管机构认定的其他情形。

### (四) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按《基金合同》规定估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于各家数据服务机构发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### (五) 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算，基金托管人对本基金的基金资产净值计算进行复核。基金托管人和基金管理人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人应向基金管理人提供基金管理人进行本基金的净值计算复核和本基金进行信息披露所需要的相关信息。

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的账册，对相



关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录相符。

#### （六）基金定期报告的编制和复核

##### 基金托管人法定报告

基金托管人需根据相关法律法规的规定向监管机构报告相关信息，包括但不限于以下内容：

- 1、自开设境外结算账户之日起 5 日内，将有关账户的详情报告外管局；
  - 2、每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金境外投资情况，并按相关监管规定进行国际收支申报；
  - 3、发现基金管理人投资指令或资金汇出违法、违规的，及时向中国证监会或外管局报告；
  - 4、中国证监会和国家外管局规定的其他报告事项；
- 对于基金托管人提供上述报告，基金管理人应予以支持和配合。

#### （七）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度和准则执行。

#### （八）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3、财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。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。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期中期报告或者年度报告。

## （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

### <六> 基金份额持有人名册的保管

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、基金份额持有人大会权利登记日、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必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为法律法规规定的期限。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年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必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保管期限为法律法规规定的期限。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

### <七> 争议解决方式

（一）本托管协议适用中华人民共和国法律并依照其解释。相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，均应提交中国国际经济贸易仲裁委员会在北京仲裁，按照申请仲裁时该会现行有

效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方均有约束力。

（二）当任何争议发生或任何争议正在进行仲裁时，除争议事项外，双方仍有权行使本协议项下的其它权利并应履行本协议项下的其它义务。

#### <八>基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以书面形式对本协议进行修改。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。《托管协议》的修改和变更应报送中国证监会核准。

##### （二）托管协议的终止

发生以下任一情况，本协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金管理人或基金托管人职责终止；
- 3、中国证监会规定的其他终止情形。

##### （三）基金财产的清算

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

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

##### 5、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）基金清算组作出清算报告；

- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 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) 公布基金清算公告；
- (9) 对基金财产进行分配。

#### 6、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。

#### 7、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。

#### 8、基金财产清算的期限为 6 个月。

## 二十三、 基金份额持有人服务

对于基金份额持有人，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）基金份额持有人交易信息查询及信息定制服务

1、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，可以到销售网点查询和打印该项交易的确认信息，或者通过基金公司客服电话及网站进行查询。

2、基金对账单服务：基金管理人向基金份额持有人提供对账单服务，基金份额持有人可自主选择对账单的发送方式，如纸制对账单、电子邮件对账单或短信对账单，或者通过基金管理人网站进行在线对账单的查询与打印。

3、信息定制服务：基金份额持有人可以通过基金管理人网站、客服热线电话、手机短信等通道提交信息定制申请。可定制的信息主要有：基金份额净值、交易确认、对账单服务等。基金管理人可根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

### （三）客户服务中心电话服务

基金管理人客户服务中心提供 24 小时自动语音查询服务，基金份额持有人可查询基金余额、交易情况、基金产品与服务等相关信息。

客户服务中心在每一工作日提供不少于 12 小时的人工咨询服务。基金份额持有人可通过基金管理人全国统一客服热线：400-888-9918（免长途话费）享受业务咨询、信息查询、信息定制、通讯资料修改、投诉建议等多项服务。

### （四）网站服务

基金份额持有人可以通过基金管理人网站（[www.99fund.com](http://www.99fund.com)）享受理财资讯、信息披露、账户信息、交易信息、在线咨询等多项服务。

基金份额持有人可以通过基金管理人网站“网上交易”办理开户、交易及查询等业务。有关基金网上交易的协议文本请参见基金管理人网站。

#### （五）投诉受理服务

基金份额持有人可以通过基金管理人客服电话、网站、信函、电子邮件（客户服务邮箱：[service@99fund.com](mailto:service@99fund.com)）、传真（021-28932998）等方式对基金管理人、销售机构所提供的服务进行投诉。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由基金管理人和各销售机构分别管理。

基金管理人客户服务中心负责受理投诉，并承诺在收到投诉后 24 小时（工作日）之内做出回应。

## 二十四、 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披露。

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	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	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2023年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
3	关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-02-08
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有停牌股票估值调整的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-03-19
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2023年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
6	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-03
7	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-16
8	汇添富香港优势精选混合型证券投资基金更新招募说明书(2024年4月18日更新)	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
9	汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-18
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-05-24
12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-06-13
13	关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资业务限制金额的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-06-17
14	关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资业务	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-07-10

	限制金额的公告		
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年第二季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-07-19
16	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与中民财富基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-08-15
17	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年中期报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-08-30
18	关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金暂停申购、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-09-14
19	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年第三季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024-10-25
20	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与乾道基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-11-20
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-12-19
22	关于汇添富香港优势精选混合型证券投资基金2025年境外市场节假日暂停申购、赎回等业务的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024-12-30



## 二十五、 招募说明书存放及其查阅方式

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。

## 二十六、 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亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、关于申请募集汇添富香港优势精选混合型证券投资基金之法律意见书；
- 3、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《汇添富香港优势精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、中国证监会有关了《关于汇添富亚洲澳洲成熟市场（除日本外）优势精选股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]23号）；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、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，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

汇添富基金管理股份有限公司

2025年1月27日