

华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金  
更新的招募说明书  
2025 年第 3 号  
(基金经理变更)

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇二五年九月

## 重要提示

华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2010 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2010】1357 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2010 年 12 月 2 日正式生效。

本基金名称自 2015 年 8 月 6 日起，由“华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞亚洲领导企业混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2015 年 8 月 6 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分股票型证券投资基金更名并修改基金合同的公告》。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于亚洲地区主要证券市场，基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会、利率、汇率等因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本次招募说明书更新主要涉及基金经理变更，并已对相应内容做出了更新，基金管理人相关信息截止日为 2025 年 9 月 11 日。除非另有说明，本更新招募说明书所载内容截止日为 2025 年 06 月 27 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2025 年 03 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

## 目录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言 .....                  | 4   |
| 二、释义 .....                  | 5   |
| 三、风险揭示 .....                | 9   |
| 四、基金的投资 .....               | 13  |
| 五、基金的业绩 .....               | 27  |
| 六、基金管理人 .....               | 29  |
| 七、境外投资顾问 .....              | 37  |
| 八、基金的募集 .....               | 38  |
| 九、基金合同的生效 .....             | 42  |
| 十、基金份额的申购、赎回与转换 .....       | 43  |
| 十一、基金的费用和税收 .....           | 52  |
| 十二、基金的财产 .....              | 54  |
| 十三、基金资产的估值 .....            | 55  |
| 十四、基金的收益与分配 .....           | 58  |
| 十五、基金的会计与审计 .....           | 60  |
| 十六、基金的信息披露 .....            | 61  |
| 十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... | 66  |
| 十八、基金托管人 .....              | 68  |
| 十九、境外托管人 .....              | 70  |
| 二十、相关服务机构 .....             | 77  |
| 二十一、基金合同的内容摘要 .....         | 79  |
| 二十二、基金托管协议的内容摘要 .....       | 98  |
| 二十三、对基金份额持有人的服务 .....       | 107 |
| 二十四、其他应披露事项 .....           | 109 |
| 二十五、招募说明书存放及查阅方式 .....      | 111 |
| 二十六、备查文件 .....              | 112 |

## 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》）、《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》）、《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《流动性风险规定》）、《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》）等有关法律法规以及《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）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。基金投资者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。基金投资者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。

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会核准。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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

|             |                                                                                  |
|-------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 基金或本基金：     | 指华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金；                                                            |
| 基金合同或本基金合同： | 指《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充；                                       |
| 招募说明书：      | 指《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；                                                 |
| 托管协议：       | 指《华泰柏瑞亚洲领导企业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《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金发售公告》；                                                      |
| 基金产品资料概要：   | 指《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；                                              |
| 中国证监会：      | 指中国证券监督管理委员会；                                                                    |
| 中国银保监会：     | 指中国银行保险监督管理委员会；                                                                  |
| 外管局：        | 指国家外汇管理局；                                                                        |
| 《基金法》：      | 指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》； |
| 《销售办法》：     | 指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；            |
| 《运作办法》：     | 指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；            |
| 《信息披露办法》：   | 指中国证监会 2019 年 7 月 26 日公布、同年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；             |
| 《流动性风险规定》：  | 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；   |

|          |                                                                                          |
|----------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 元：       | 指人民币元；                                                                                   |
| 基金管理人：   | 指华泰柏瑞基金管理有限公司；                                                                           |
| 基金托管人：   | 指中国银行股份有限公司；                                                                             |
| 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；                                       |
| 注册登记业务：  | 指本基金登记、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；               |
| 注册登记机构：  | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；                |
| 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证券投资基金的其他投资者；                                                 |
| 个人投资者：   | 指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；                                                         |
| 机构投资者：   | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；                         |
| 基金份额持有人： | 指依招募说明书和基金合同合法取得本基金基金份额的投资者；                                                             |
| 基金募集期：   | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；                                    |
| 基金合同生效日： | 指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日； |
| 存续期：     | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；                                                                     |
| 工作日：     | 指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；                                                                  |
| 开放日：     | 指基金管理人指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；                                                             |
| 认购：      | 指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；                                                    |
| 申购：      | 指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金                                                               |

|         |                                                                        |
|---------|------------------------------------------------------------------------|
|         | 基金份额的行为；                                                               |
| 赎回：     | 指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人卖出本基金基金份额的行为；                  |
| 基金转换：   | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；   |
| 转托管：    | 基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；                           |
| 投资指令：   | 指基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；                   |
| 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，并接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构； |
| 销售机构：   | 指基金管理人及本基金代销机构；                                                        |
| 基金销售网点： | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；                                               |
| 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；   |
| 基金账户：   | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；                  |
| 交易账户：   | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换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；       |
| T 日：    | 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日；                                            |
| T+n 日：  | 指自 T 日起第 n 个工作日（不包括 T 日）                                               |
| 基金收益：   | 指基金投资所得红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息、外汇兑换损益及其他合法收入；                              |
| 基金资产总值： | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；                       |
| 基金资产净值： | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；                                                     |
| 基金份额净值  | 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单                                             |

|          |                                                                                                                                                                                              |
|----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          | 位基金份额的价值；                                                                                                                                                                                    |
| 流动性受限资产： | 指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券，因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；                                                    |
| 基金资产估值：  | 指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；                                                                                                                                                        |
| 法律法规：    | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；                                                                                                                          |
| 不可抗力：    | 指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的事件和因素。包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。 |

### 三、风险揭示

本基金面临的风险基本可分为市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险及合法合规风险等几大类。本基金管理人将本着科学、严谨的原则，对基金风险的识别、评估和控制等全过程进行严格管理。

#### （一）市场风险

市场风险是指由于各种市场因素（如股票价格、利率、汇率、商品价格等）变化而造成的投资组合价值波动，给基金资产带来潜在的风险。本基金将投资于亚洲不同区域的证券市场，不同市场中的风险暴露具有复杂的关联关系，需要通过一定的手段对相关的风险暴露进行归并和整理。

##### 1、海外市场风险

本基金投资于境外证券市场，各国或地区处于产业景气循环周期的不同阶段，将对基金的投资绩效产生影响；同时，境外证券市场因特有的社会政治环境、法律法规、市场状况和经济发展趋势，对特定的负面事件的反应存在诸多差异；另外，部分投资市场，如香港，其证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此，这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大。上述因素可能会带来市场的急剧波动，从而引起投资风险的增加。

##### 2、新兴市场风险

由于本基金涉及海外新兴市场的证券投资，鉴于各新兴市场特有的监管制度（包括市场准入制度、外汇管制等）和市场行为的特有的不稳定状态，可能对本基金参与新兴市场的投资收益产生直接或间接的影响。

##### 3、购买力风险

基金收益的部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降，这就是购买力风险。

##### 4、利率风险

利率风险是指利率的变动对金融资产价格带来的影响。金融市场利率的波动会直接导致股票及债券的市场价格和收益率发生变动，同时也影响到证券市场资金供求状况以及上市公司的融资成本和利润水平。这些因素的变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

##### 5、汇率风险

由于不同国家的证券采用不同的货币进行标价，汇率的变动将直接或间接地影响以人民币表示的基金资产的价格或价值，导致基金份额持有人利益受损，从而产生汇率风险。汇率风险是本基金面临的重要风险之一。

##### 6、大宗商品风险

虽然本基金不直接投资于钢材、石油、煤炭、有色金属等大宗商品，但这些商品价格的变化可能对相关上市公司经营业绩带来负面影响，从而对本基金参与相关证券投资的收益带来间接的影响。

#### 7、非系统风险

非系统性风险是指单个证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等，都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的股票和债券的发行人经营不善，导致其股票价格下跌、股息、红利减少，或者存在所投资的企业债券发行人无法按时偿付本息，从而使基金投资收益下降。

### （二）信用风险

信用风险是指债务人或交易对手未能履行金融工具的义务或信用质量发生变化，影响金融工具的价值，从而给债权人或金融工具持有人带来损失的风险。信用风险由两部分组成：

1、违约风险，即交易一方不愿或无力支付约定款项而致使交易另一方遭受损失的可能性，在违约的情况下，根据合约签定时的保护性条款的安排，一部分债权会得到受偿，这一比率成为挽回率。

2、信用差别风险，是指由于信用品质的变化引起信用价差的变化而导致的损失，具体由信用价差跳动风险和信用价差波动风险组成。

3、国家信用风险。国家风险或称主权风险，是指由于投资标的国家或地区违约或进行政府管制的风险。

在基金面临的众多信用风险中交易对手风险是重要的风险之一。交易对手风险是指预期在交易期间，交易对手违反合约或不能履行合约约定的义务，包括支付应付款项、支付应付证券、提供金融服务等义务，或因交易对手的其他原因导致本基金损失的风险。

### （三）流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金是契约型开放式基金，基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资者的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。与国内的基金产品不同，本基金在赎回时要经过抛售股票、兑换外币、跨境转账等环节，在这些环节中均存在着一定的风险，而这些风险都大大地增加了产品的流动性风险。

#### （四）操作风险

操作风险是指由于内部控制制度不健全或失效等原因导致的风险。操作风险又可以包括以下几种具体风险：

##### 1、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误；或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门；或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益的直接损失。

##### 2、系统故障风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

##### 3、金融模型风险

金融模型风险是指由于投资决策或风险管理依赖的金融模型错误或参数不准确而引发的风险。

##### 4、交易结算风险

在基金的投资交易中,因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

##### 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或错误,通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中,由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失,从而对基金收益造成影响的风险。

##### 6、税务风险

税务风险指在基金投资中与股息收入和资本利得相关的税法发生变化，令股票的吸引力减弱或者股票的回报减少的风险。

#### （五）合法合规风险

合法合规风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而引起法律制裁、重大财务损失或者声誉损失的风险，主要包括如下具体风险：

##### 1、法律风险

法律风险是指基金管理人违反法律法规、基金合同从而给基金份额持有人利益带来损失的风险。

##### 2、道德风险

道德风险是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

## （六）其它风险

### 1、金融衍生品风险

金融衍生品的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，其保证金交易制度产生了杠杆作用。一方面，由于交易成本非常低，杠杆作用可使金融衍生品成为一种对冲风险和投机的有效工具；另一方面，杠杆作用使得潜在的风险和收益同时放大，在基础资产的价格剧烈变动时，由于杠杆作用和投资者的非理性预期，金融衍生品往往给投资组合带来难以估算和控制的风险。

本基金将不对金融衍生品作主动配置，只会适当地用来对冲风险。

### 2、政府管制风险

在境外证券投资过程中，投资地所在国家或地区政府部门还可能针对本基金实施投资运作、交易结算以及资金汇出入等方面的限制，或者采取资产冻结或扣押等行政措施，从而造成相应的财产受损、交易延误等相关风险。

### 3、其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 四、基金的投资

### （一）投资目标

采取主动精选亚洲地区具有行业领导地位和国际竞争优势的企业，通过区域化分散投资，有效降低投资组合系统性风险，追求基金资产长期稳健增值。

### （二）投资理念

亚洲地区已经成为推动全球经济复苏的主要动力，其经济增速也远高于世界其他地区。本基金管理人将深入研究该区域内的经济发展趋势以及政策导向，采取主动精选证券和适度资产配置相结合的投资策略，发掘具有行业领导地位和国际竞争优势的企业，实施全程风险管理，在保持资产良好流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

### （三）投资范围

本基金可投资于下列金融产品或工具：权益类品种，包括普通股、优先股、全球及美国存托凭证、股票型基金等；固定收益类品种，包括政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券；银行存款、回购协议、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资的股票占基金资产的比例不低于 60%；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于 40%，其中，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金不低于 80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。亚洲领导企业是指在亚洲地区证券市场进行交易或至少 50%的主营业务收入来自于亚洲地区而在亚洲以外交易所上市的企业，同时具有较高的市场占有率和盈利能力、卓越的研发和生产能力、先进的市场营销手段和网络、核心的品牌优势和资源储备、科学的公司治理、创新的商业模式、良好的企业管理团队等要素的，能够为股东带来超额收益的上市公司。

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

### （四）投资策略

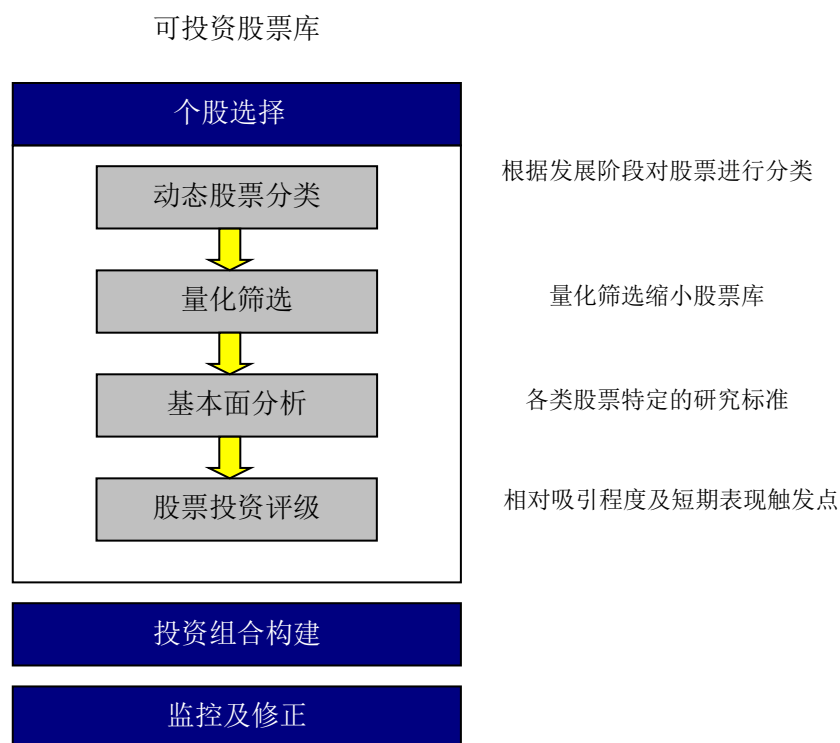
#### 1、国别与地区资产配置策略：

本基金投资研究团队将跟踪全球经济的发展趋势，重点研究亚洲地区内的宏观经济变

量，采用自上而下的分析方法，以及定性和定量分析模型相结合的手段，确定基金资产在各国家/地区之间的配置。综合分析亚洲地区内的宏观经济指标、公司盈利发展趋势、资金流向、价格变动、社会政治风险、产业结构性风险等要素，采用专有定量模型作为参考工具，以确定各国股市的相对吸引力。通过将市场预期的净资产收益率、市净率及长期债券收益率等多种金融市场变量输入该模型，来确定各个市场的价值中枢，作为估值标准。

## 2、股票投资策略：

在确定国家/地区资产配置的基础上，本基金管理人将自下而上精选估值合理、具有持续成长能力的领导企业。具体投资流程如下图所示：



### （1）可投资股票库的确定

本基金主要投资于在亚洲地区证券市场进行交易或其主要业务经营在亚洲地区而在亚洲以外交易所上市且具有良好流动性的上市公司股票。

### （2）动态股票分类

根据企业成长阶段特性，将股票库的所有股票分为以下四个类别：突出成长、高速稳定增长、高速周期增长及成熟公司。该分类系统分析的变量包括每股收益历史增长率、每

股收益 3 年预测增长率及每股收益相关系数。该分类系统将会定期修正，然后进行确认或做出改进。该分类系统有助于确定适当的分析方法及估值标准体系。

|   | 成长类别   | 主要特征                                                   |
|---|--------|--------------------------------------------------------|
| A | 突出成长   | 新商业模式；创新科技、创新材料。                                       |
| B | 高速稳定成长 | 极强的定价能力，销售盈利稳定快速增长；极强的成本控制能力，能稳定快速占有市场。                |
| C | 高速周期成长 | 行业具有周期波动的特征，具有长期良好增长趋势，能通过产能扩张，不断扩大市场份额，在周期性波动中实现业绩增长。 |
| D | 成熟阶段   | 传统行业，技术或市场已趋于平稳和成熟。                                    |

### （3）股票的筛选及评级

通过合理估值、基本面趋势等标准对上述各类企业进行基本面分析和量化筛选。在合理估值环节，将采用相对估值指标（PE、PB、PS、EV/EBITDA 等）以及绝对估值模型（DCF、DDM 等）进行全面比较，发掘那些处于合理估值区间的优质公司。在判断上市公司基本面趋势时，本基金将采用各类别特定的估值标准对公司未来的成长性进行界定。例如，对于一家处于高速周期增长的公司，将重点关注其发展前景是否正在改善，并且就产品周期、竞争地位及潜在增长趋势进行综合评价。基本面趋势分析将有助于本基金识别那些具有持续成长能力的行业领导企业。

在对上述因素进行综合分析的基础上，给予上市公司 1 级（强烈买入）至 5 级（强烈卖出）的投资评级。1 级和 2 级股票为增持，3 级至 5 级股票为中性、减持或全部卖出。

### （4）投资组合的构建及优化

基于股票的预期收益与风险特性，对投资组合进行优化。在既定风险水平下追求收益最大化，或者在既定的预期收益目标下追求投资组合风险最小化。随着市场环境的变化，本基金还将对投资组合进行不断调整与优化。

为了避免“自下而上”的选股方法可能造成行业集中度过高而引起的组合流动性风险和非系统性风险，本基金将在对各地宏观经济和产业政策、行业的基本面趋势、整体估值水平等因素进行深入研究的基础上，综合分析各行业投资价值，评估不同行业在组合中的估值水平、成长性以及风险状况，对股票组合进行适当的行业分布调整。

### （5）投资组合监控

本基金将持续监控投资组合内各个股票的估值水平变化、盈利能力及基本面趋势变化，根据这些变化对投资组合进行调整。

### 3、其它金融工具的投资策略

本基金对固定收益类资产和货币市场工具的投资将以优化投资组合风险收益特征，降低组合风险为主要目的。

本基金不采用积极的衍生品投资策略，衍生工具的投资不以资本利得为目的，主要用以规避组合资产的风险（如外汇风险、利率风险等）以及提高投资组合管理的效率。

### （五）业绩比较基准

MSCI 亚太综合指数（不含日本）（MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index）。

该指数是由摩根士丹利资本国际公司(MSCI)按照自由流通市值调整方法编制的跟踪亚太地区股票市场的投资指数,指数覆盖了包含亚太地区 13 个国家和地区市场上市的大中型股票，能够全面、准确地反映亚太区股票市场的价格走势，是适合作为本基金投资业绩比较基准的指数。日本将不作为本基金的主要投资市场。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人应在调整前在指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。

截至 2010 年 6 月底，该指数的构成和权重如下表所示：

|    | 国家或地区 | 权重%   |
|----|-------|-------|
| 1  | 澳大利亚  | 24.87 |
| 2  | 韩国    | 14.20 |
| 3  | 香港*   | 13.86 |
| 4  | 中国**  | 13.83 |
| 5  | 台湾    | 11.26 |
| 6  | 印度    | 8.67  |
| 7  | 新加坡   | 5.03  |
| 8  | 马来西亚  | 3.06  |
| 9  | 印度尼西亚 | 2.53  |
| 10 | 泰国    | 1.58  |
| 11 | 菲律宾   | 0.50  |
| 12 | 新西兰   | 0.32  |
| 13 | 澳门    | 0.19  |

\*：香港主要指在香港上市的本地企业股；\*\*：中国主要指在香港上市的 H 股、红筹股和美国上市的中国企业股。

## （六）风险收益特征

本基金为区域性混合型证券投资基金，基金预期投资风险收益水平高于混合型基金和债券型基金。由于投资国家与地区市场的分散，长期而言风险应低于投资单一市场的混合型基金。

## （七）投资决策依据及流程

### 1、决策依据

- （1）国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；
- （2）投资研究团队对于全球，特别是亚洲地区宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议；
- （3）投资研究团队对于上市公司基本面的分析报告和建议；
- （4）投资风险管理人员对于投资组合风险评估的报告和建议。

### 2、投资决策流程

投资决策委员会负责审定基金经理的整体投资策略和原则；审定基金经理季度资产配置和调整计划；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

基金经理设定投资策略，构建优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理。

基金经理助理/研究员：通过内部调研和参考外部研究报告，对全球以及亚洲地区宏观经济发展态势、各国证券市场运行环境和走势，以及上市公司的基本面进行分析，形成宏观经济、行业以及个股的投资分析报告，提交基金经理，为投资策略提供依据。

具体投资程序如下：

- （1）研究部、海外投资部和集中交易室通过自身研究及借助外部研究机构形成有关上市公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会依据上述报告对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对境外证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划。

(4) 集中交易室依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

(5) 风险管理部对投资组合计划的执行过程进行监控。

(6) 基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

#### **(八) 投资限制**

1、本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，但存放于托管行的存款除外；

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

3、本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市值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市值不得超过基金资产净值的 3%；

4、本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。同一境内机构投资者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；

5、本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%；

前项非流动性资产是指法律或本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、同一境内机构投资者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%；

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

8、本基金投资的股票占基金资产的比例不低于 60%；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于 40%；

9、本基金投资现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；

10、本基金的金融衍生品全部敞口不得高于本基金资产净值的 100%；

11、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%；

12、本基金投资金融衍生品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%；

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

14、本基金境内投资还应遵守以下限制：

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

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整；

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

15、相关法律法规、基金合同及中国证监会的其他规定。

### （九）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、购买不动产；
- 2、购买房地产抵押按揭；
- 3、购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- 4、购买实物商品；
- 5、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%；
- 6、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- 7、参与未持有基础资产的卖空交易；
- 8、从事证券承销业务；
- 9、向他人贷款或者提供担保；
- 10、从事承担无限责任的投资；
- 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、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人、境外托管人发行的股票或者债券；
- 13、买卖与其基金管理人、基金托管人、境外托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 14、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 15、不公平对待不同客户或不同投资组合。
- 16、除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。
- 17、依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### （十）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第 9、13、14 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

#### （十一）基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- 2、有利于基金财产的安全与增值。

#### （十二）代理投票

基金管理人作为基金份额持有人的代理人，代表基金持有人参加上市公司股东大会，既是基金管理人的职责也是代表基金持有人行使股东权利、充分保护投资者利益的重要手段。基金管理人将本着维护持有人利益的原则，勤勉尽责的代理基金份额持有人行使投票权。

代理投票流程：

- 1、公司收到股东大会通知后，经基金经理、相关研究员讨论决定，形成表决意见后，由海外投资部总监以法律法规许可的方式行使投票权。
- 2、投票意见应归档，并根据有关规定保存。
- 3、在履行代理投票职责过程中，基金管理人可根据实际操作需要，委托基金托管人或其他专业机构提供代理投票的建议、协助完成代理投票的程序等，基金管理人应对代理机构的行为进行必要的监督，保留投票记录，并承担相应责任。专业机构提供的服务内容包括：协调确保所有代理投票有关材料及时处理；提供详尽的提案分析和基于公司标准的投票建议；接受委托，行使代理投票权。
- 4、参加股东大会的人员，需要就会议内容、表决事项，撰写会议纪要，供投资决策参考。

#### （十三）证券交易

- 1、经纪商选择标准：

(1) 经纪商的财务实力方面，净资产、总市值、信用评级等指标处于行业前列地位。

(2) 经纪商的组织框架和业务组成方面，能体现出战略规划和定位，能积极推动多边业务合作，最大限度的调动整体资源，为基金投资赢取机会。

(3) 经纪商的研究支持服务方面，能针对本基金业务需要，提供较全面服务，包括举办推介会、拜访公司、提供研究报告、及时沟通市场情况、协助交易评价等。

(4) 经纪商的交易执行能力方面，能够公平对待所有的帐户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等。

(5) 经纪商的后台便利性、可靠性方面，交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等。

(6) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

根据证券市场参与者分布格局，对表现突出的经纪商进行综合评估，从中选取最适合基金投资业务，最有保障的合作对象。认同业内的权威评级机构或媒体做出的评级结果，特别重视交易所在地的经纪商各项实力排名。

高度专业素质和诚信度是经纪商必须遵行的重要准则，若经纪商不遵循最佳成交原则，发生的交易行为有利于其他客户而不是我公司；或向任何第三方泄露我公司操作情况，公司有权主动解除与其的一切合作，严重者追究法律责任。

## 2、经纪商评估以及交易量的分配

本基金管理人以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

评估的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

集中交易室在优先考虑排名靠前的经纪商进行交易时，还应根据市场的实际情况、结合投资指令的数量和券商的流动性，本着寻求最佳交易执行，力求交易成本最小化的原则将指令分发给最合适的经纪商。

## 3、软佣金的管理

本基金管理人在从事投资管理业务时，需要委托经纪商执行相关的证券交易事宜，同时可能接受经纪商提供的服务，通常包括交易执行、数据统计、市场研究、经济环境分析、行业与公司情况分析，以及资产和市场配置的相关建议等。此类服务通称为软佣金。

软佣金协议由本基金管理人与经纪商共同签订，这些经纪商承诺与本基金管理人建立长期稳定的合作关系并提供优质服务。本基金管理人可与经纪商签署相关协议，经纪商们同意使用一部分收取的交易佣金来支付本基金某些从第三方处得到的投资相关服务费用。

为避免与基金份额持有人的利益相冲突，本基金管理人在接受软佣金安排时需满足如

下条件：

- (1) 本基金管理人须具备相关的软佣金管理制度；
- (2) 支付给经纪商的佣金费率不得高于市场费率平均水平；或有充分理由证明经纪商所提供的经纪服务与研究服务的价值能够解释并包容高于市场平均水平的佣金费率；
- (3) 软佣金不得与投资者的利益冲突；
- (4) 软佣金仅能用于被明确描述的服务；
- (5) 须确保软佣金协议有助于提高投资管理相关服务水平，并且软佣金的使用须以符合最佳交易执行和投资者利益原则为前提；
- (6) 软佣金协议须符合中国的有关法律法规。

#### (十四) 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2025 年 03 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

##### 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              | 66,782,300.19 | 90.16        |
|    | 其中：普通股            | 66,782,300.19 | 90.16        |
|    | 优先股               | —             | —            |
|    | 存托凭证              | —             | —            |
|    | 房地产信托凭证           | —             | —            |
| 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      | 6,761,845.72  | 9.13         |
| 8  | 其他资产              | 523,518.80    | 0.71         |
| 9  | 合计                | 74,067,664.71 | 100.00       |

##### 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   | 66,782,300.19 | 94.41        |
| 合计     | 66,782,300.19 | 94.41        |

##### 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 (%) |
|--------|---------------|--------|
| 金融     | 4,586,465.10  | 6.48   |
| 必需消费品  | 1,617,259.58  | 2.29   |
| 通信服务   | 1,437,769.14  | 2.03   |
| 能源     | 2,821,091.31  | 3.99   |
| 房地产    | 29,680,058.46 | 41.96  |
| 医疗保健   | 17,023,491.15 | 24.06  |
| 非必需消费品 | 8,176,550.65  | 11.56  |
| 工业     | 1,439,614.80  | 2.04   |
| 原材料    | -             | -      |
| 公共事业   | -             | -      |
| 信息科技   | -             | -      |
| 合计     | 66,782,300.19 | 94.41  |

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

#### 4、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

##### 4.1 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<br>(英文)                           | 公司名称<br>(中文)         | 证券<br>代码   | 所在<br>证券<br>市场         | 所属<br>国家<br>(地区) | 数量<br>(股)         | 公允价<br>值 (人<br>民币元) | 占基金资产<br>净值比例 (%) |
|----|----------------------------------------|----------------------|------------|------------------------|------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
| 1  | CHINA<br>JINMAO<br>HOLDINGS<br>GROUP   | 中国金茂<br>控股集团<br>有限公司 | 817<br>HK  | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港       | 3,00<br>0,00<br>0 | 3,488,<br>297.40    | 4.93              |
| 2  | CHINA<br>OVERSEAS<br>GRAND<br>OCEANS   | 中国海外<br>宏洋集团<br>有限公司 | 81 HK      | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港       | 2,00<br>0,00<br>0 | 3,451,<br>384.20    | 4.88              |
| 3  | CHINA<br>MERCHANT<br>S BANK-H          | 招商银行<br>股份有限<br>公司   | 3968<br>HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港       | 80,0<br>00        | 3,388,<br>631.76    | 4.79              |
| 4  | NEW<br>ORIENTAL<br>EDUCATIO<br>N & TEC | 新东方教<br>育科技集<br>团    | 9901<br>HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港       | 100,<br>000       | 3,372,<br>943.65    | 4.77              |
| 5  | GREENTOW<br>N CHINA<br>HOLDINGS        | 绿城中国                 | 3900<br>HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港       | 320,<br>000       | 3,248,<br>361.60    | 4.59              |
| 6  | CHINA<br>OVERSEAS<br>LAND &<br>INVEST  | 中国海外<br>发展           | 688<br>HK  | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港       | 250,<br>000       | 3,206,<br>834.25    | 4.53              |
| 7  | KE                                     | 贝壳控股                 | 2423       | 香 港                    | 中 国              | 62,0              | 3,032,              | 4.29              |

|    |                                            |                      |            |                        |            |             |                  |      |
|----|--------------------------------------------|----------------------|------------|------------------------|------------|-------------|------------------|------|
|    | HOLDINGS<br>INC-CL A                       | 有限公司                 | HK         | 联 合<br>交 易<br>所        | 香 港        | 00          | 419.38           |      |
| 8  | WUXI<br>BIOLOGIC<br>S CAYMAN<br>INC        | 药明生物<br>技术有限公司       | 2269<br>HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港 | 120,<br>000 | 2,995,<br>506.18 | 4.23 |
| 9  | C&D<br>INTERNAT<br>IONAL<br>INVESTME<br>NT | 建发国际<br>投资集团<br>有限公司 | 1908<br>HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港 | 200,<br>000 | 2,989,<br>969.20 | 4.23 |
| 10 | EVEREST<br>MEDICINE<br>S LTD               | 云顶新耀<br>有限公司         | 1952<br>HK | 香 港<br>联 合<br>交 易<br>所 | 中 国<br>香 港 | 60,0<br>00  | 2,965,<br>052.79 | 4.19 |

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。

6、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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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  
细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

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。

10、投资组合报告附注

10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行(3968 HK)的发行主体招商银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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    | 55,046.81  |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 468,471.99 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 523,518.80 |

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。

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。

10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 五、基金的业绩

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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2025 年 03 月 31 日。

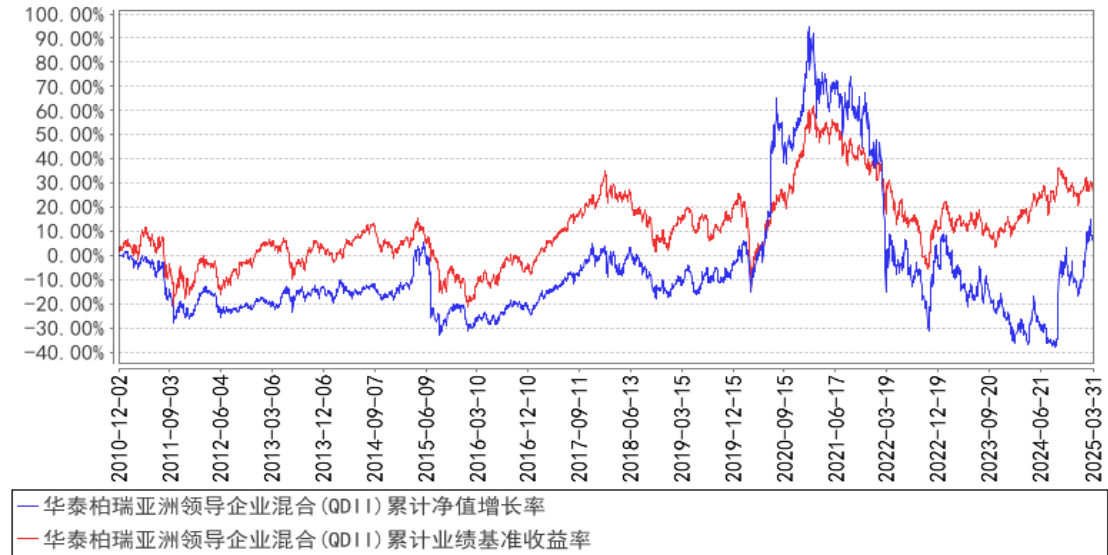
### 1、 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

| 阶段                    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|-----------------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 2010.12.02-2010.12.31 | 0.50%    | 0.17%       | 5.24%      | 0.68%         | -4.74%  | -0.51% |
| 2011.01.01-2011.12.31 | -25.27%  | 1.15%       | -17.98%    | 1.49%         | -7.29%  | -0.34% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | 8.66%    | 0.74%       | 18.65%     | 0.94%         | -9.99%  | -0.20% |
| 2013.01.01-2013.12.31 | 4.04%    | 0.92%       | 0.46%      | 0.85%         | 3.58%   | 0.07%  |
| 2014.01.01-2014.12.31 | 0.82%    | 0.73%       | -0.20%     | 0.62%         | 1.02%   | 0.11%  |
| 2015.01.01-2015.12.31 | -7.59%   | 1.48%       | -11.97%    | 1.09%         | 4.38%   | 0.39%  |
| 2016.01.01-2016.12.31 | -2.65%   | 0.96%       | 3.74%      | 1.00%         | -6.39%  | -0.04% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | 29.48%   | 0.82%       | 33.50%     | 0.54%         | -4.02%  | 0.28%  |
| 2018.01.01-2018.12.31 | -14.64%  | 1.23%       | -16.25%    | 0.99%         | 1.61%   | 0.24%  |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 14.45%   | 1.01%       | 15.85%     | 0.73%         | -1.40%  | 0.28%  |
| 2020.01.01-2020.12.31 | 72.28%   | 1.97%       | 19.80%     | 1.55%         | 52.48%  | 0.42%  |
| 2021.01.01-2021.12.31 | -14.12%  | 1.84%       | -4.88%     | 0.95%         | -9.24%  | 0.89%  |
| 2022.01.01-2022.12.31 | -34.63%  | 2.63%       | -19.72%    | 1.34%         | -14.91% | 1.29%  |
| 2023.01.01-2023.12.31 | -18.58%  | 1.80%       | 4.60%      | 0.90%         | -23.18% | 0.90%  |
| 2024.01.01-2024.12.31 | 16.69%   | 2.27%       | 7.66%      | 0.88%         | 9.03%   | 1.39%  |
| 2025.01.01-2025.03.31 | 18.10%   | 2.05%       | 0.62%      | 0.90%         | 17.48%  | 1.15%  |
| 自基金合同生效起至今            | 5.70%    | 1.52%       | 25.92%     | 1.03%         | -20.22% | 0.49%  |

- 2、 图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华泰柏瑞亚洲领导企业混合(QDII)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2010 年 12 月 2 日至 2025 年 3 月 31 日。

## 六、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：汪莹白

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：华泰证券股份有限公司 49%、PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001 年 7 月至 2016 年 11 月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任公司董事长。自 2025 年 5 月起，代为履行总经理职务。

陆春光先生：董事，学士，2009 年 5 月加入华泰证券，曾任网络金融部互联网运营团队负责人、用户体验与设计团队负责人、副总经理，现任华泰证券上海分公司总经理。

Kirk Chester SWEENEY 先生：董事，学士，1982 年 9 月加入 United States Trust Co of NY，1984 年至 1988 年任 Drexel Burnham Lambert 副总裁，1988 年至 1990 年任 Morgan Stanley（纽约）副总裁，1990 年至 1992 年任 Wardley-Thomson Securities（香港）董事，1992 年至 2008 年任雷曼兄弟亚洲（香港）董事总经理兼香港地区负责人，2009 年至 2010 年任野村证券（香港）董事总经理，2010 年至 2013 年任巴克莱资本（香港）董事总经理，2013 年至 2019 年任 Millennium Capital Management（香港/新加坡）Pte Ltd 亚洲首席执行官，2019 年至 2020 年任泓策投资管理有限公司总裁，2020 年至 2021 年任 ExodusPoint

Capital Management Hong Kong, Limited 亚洲区主管兼香港首席执行官，2021 年至今任柏瑞投资亚洲有限公司亚洲首席执行官。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司，华之杰国际商业顾问有限公司，1992 年 4 月至 1996 年 12 月任 AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理，1997 年 1 月至 2001 年 7 月任 AIG 友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理，2001 年 7 月至 2010 年 2 月任 AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理。2010 年 2 月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

李晗女士：独立董事，硕士，2007 年加入天元律师事务所，2015 年至今任该律师事务所合伙人。

田中荣治先生：独立董事，硕士，曾任职于野村证券株式会社、瑞穗证券亚洲有限公司、野村国际（香港）有限公司、野村资产管理香港有限公司。2022 年 9 月至今任中国国际金融日本株式会社代表取缔役社长。

孙茂竹先生：独立董事，硕士，1987 年 6 月至 2019 年 2 月任中国人民大学商学院教授、博士生导师。2019 年 2 月从中国人民大学退休。

尹雷先生：独立董事，硕士，曾任深圳证券交易所经理、麦顿投资副总裁、凯鹏华盈基金执行董事、阿里巴巴集团投资总监、阿里巴巴影业集团副总裁、海南阿里影业文化产业基金总裁，2019 年至今任厦门云尚汇影影视文化有限公司董事长。

## 2、监事会成员

刘晓冰先生：监事长。1993 年 12 月进入华泰证券股份有限公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

卢龙威先生：监事，学士，曾任职于毕马威会计师事务所、安永会计师事务所、华为技术有限公司、荷兰银行（香港）、英美烟草（香港）有限公司、苏格兰皇家银行（香港），2014 年 10 月加入柏瑞投资亚洲有限公司，现任柏瑞投资亚洲有限公司全球税务主管兼亚太区财务总监。

刘声先生：监事，硕士。2011 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任风险管理部副总监。

赵景云女士：监事，硕士。2006 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金事务部总监。

## 3、总经理及其他高级管理人员

贾波先生：简历同上。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001 年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004 年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监，2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

刘万方先生：督察长，财政部财政科学研究所财政学博士。曾任中国普天信息产业集团公司项目投资经理，美国 MBP 咨询公司咨询顾问，中国证监会主任科员、副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长，朱雀股权投资管理股份有限公司副总经理，朱雀基金管理有限公司总经理。2019 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司督察长。

满黎先生：副总经理，硕士。曾任华安基金管理有限公司北京分公司高级董事总经理，国联安基金管理有限公司副总经理，金鹰基金管理有限公司副总裁，万家基金管理有限公司副总经理。2021 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任副总经理。

童辉先生：首席信息官，硕士。1997-1998 年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004 年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任首席信息官兼信息技术部总监。

裴晓思先生：副总经理，复旦大学硕士。曾任泰和诚医疗集团行业研究员，中国出口信用保险公司投资经理，永诚财产保险有限公司投资经理，易方达基金管理有限公司非银客户部总经理助理（主持工作），2021 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司副总经理。

周俊梁先生：财务总监，硕士。曾任普华永道中天会计师事务所审计经理、渣打银行（中国）有限公司财务部高级经理、大华银行（中国）有限公司财务部第一副总裁，2015 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司财务总监。

柳军先生：副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红

利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

王文慧女士：副总经理，经济学硕士。2005 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任第一营销中心总监、第二营销中心总监、机构理财部总监、机构业务一部总监、华中营销中心总监、券商业务部总监、总经理助理兼券商业务部总监，现任公司副总经理兼券商业务部总监。

#### 4、本基金基金经理

何琦先生，上海交通大学经济学学士。曾任汇丰银行证券服务部证券结算师，2008 年 11 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，曾任交易部高级交易员，海外投资部基金经理助理。2017 年 7 月起任华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金和华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 1 月起任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月

起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。

张弘先生，上海交通大学硕士，曾任浙商证券股份有限公司研究员，东方证券股份有限公司研究员，兴全基金管理有限公司研究员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理、博时基金管理有限公司基金经理。2024 年 2 月起任华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起任华泰柏瑞港股通医疗精选混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月起任华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、权益投资决策委员会成员

主席：董事长、总经理（代任）贾波先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理柳军先生；总经理助理沈雪峰女士；总经理助理董辰先生；总经理助理莫倩女士；主动权益投资总监方纬先生；投资一部总监杨景涵先生；主动权益投资副总监吕慧建先生。

列席人员：督察长或风险管理部总监可列席投资决策委员会会议。总经理可以提名其他人员列席投资决策委员会会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人将严格遵守基金合同,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、基金管理人不得从事违反《基金法》的行为,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

- (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牟取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5) 用基金资产承销证券;
- (6) 用基金资产向他人贷款或提供担保;
- (7) 用基金资产从事承担无限责任的投资;
- (8) 用基金资产买卖其他基金份额,但国务院另有规定的除外;
- (9) 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (10) 以基金资产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
- (11) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (12) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

3、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) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
- (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) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;
- (9) 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;
- (10) 贬损同行,以抬高自己;

- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象；
- (14) 法律法规禁止的其他行为。

#### 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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不正当利益。
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

- (1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；
- (2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；
- (3) 独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；
- (4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；
- (5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；
- (6) 成本效益原则。公司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。

##### 2、内部控制的主要内容

###### (1) 控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审

查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

#### （2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

#### （3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确；

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 七、境外投资顾问

本基金不聘请境外投资顾问，华泰柏瑞基金管理有限公司将对全部资产进行自行管理。

## 八、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

本基金经 2010 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】【1357】号文核准募集。

### （二）基金类型

混合型基金。

### （三）基金的运作方式

契约型、开放式。

### （四）基金存续期间

不定期。

### （五）基金的面值

本基金每份基金份额的初始面值为 1.00 元人民币。

### （六）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点,具体名单见基金份额发售公告及代销机构的相关公告)向投资者公开发售。

### （七）募集期限

本基金自 2010 年 11 月 1 日至 2010 年 11 月 26 日公开发售。如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间,本基金可继续销售,但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售。

### （八）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者和机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## （九）基金的最高募集规模

本基金将按照中国证监会和国家外汇管理局核准的额度(美元额度需折算为人民币)设定基金募集上限，募集期内超过募集目标上限时采取比例配售的方式进行确认，具体办法参见《发售公告》。

## （十）认购安排

### 1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在发售公告中确定并披露。

### 2、认购的方式及确认

（1）本基金认购采取金额认购的方式。

（2）销售网点（包括直销中心和代销网点）受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认为准。投资者可在本基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

（3）基金投资者在募集期内可以多次认购，认购一经受理不得撤消。

（4）若投资者的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

### 3、认购的限额

（1）在募集期内，投资者可多次认购，对单一投资者在认购期间累计认购份额不设上限。

（2）认购最低限额：在基金募集期内，除发售公告另有规定，代销机构和基金管理人的网上交易系统每个基金账户首次最低认购金额为 1000 元人民币，单笔认购最低金额为 1000 元人民币；基金管理人的直销中心每个基金账户首次最低认购金额为 5 万元人民币，已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制，单笔认购最低金额为 1000 元人民币。

各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

### 4、认购费率

本基金采取金额认购方式，认购费率最高不超过认购金额的 1.2%。

| 认购金额（元）           | 认购费率 |
|-------------------|------|
| 认购金额< 50 万        | 1.2% |
| 50 万≤认购金额< 100 万  | 1.0% |
| 100 万≤认购金额< 200 万 | 0.8% |
| 200 万≤认购金额< 500 万 | 0.5% |

|                   |          |
|-------------------|----------|
| 认购金额 $\geq$ 500 万 | 1000 元/笔 |
|-------------------|----------|

投资者重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例配售方式对有效认购金额进行部分确认时，投资者认购费率按照认购申请确认金额所对应的费率计算。采取比例配售方式对有效认购金额进行部分确认时，将导致有效认购金额低于申请认购金额，可能会出现认购费用的适用费率高于申请认购金额对应费率的情况，敬请投资者注意。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

#### 5、认购份额的计算

认购本基金的认购费用采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购资金在基金募集期间所产生的利息折成基金份额，归投资者所有，投资者的总认购份额的计算方式如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购期利息) / 基金份额初始面值

净认购金额以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；认购份额的计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者投资 10,000 元认购本基金，如果认购期内认购资金获得的利息为 10 元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额 =  $10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42$  元

认购费用 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.57$  元

认购份额 =  $(9,881.42 + 10) / 1.00 = 9,891.42$  份

即投资者投资 10,000 元认购本基金，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 9,891.42 份基金份额。

### (十一) 募集资金及利息的处理

1、基金募集期间募集的资金存入本基金公司清算账户，在基金募集行为结束前，任何人不得挪做他用。

2、有效认购资金在募集期间产生的利息折成基金份额，归投资者所有。利息折算成基金份额，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。利息的计算和折算的基金份额的具体数额以注册登记机构的计算结果为准。

## （十二）募集结果

本基金募集工作已于 2010 年 11 月 26 日顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 290,510,740.98 元人民币，折合基金份额 290,510,740.98 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 54,587.82 元人民币，折合基金份额 54,587.82 份。本次募集所有资金已于 2010 年 11 月 30 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 2,515 户，按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 290,565,328.80 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。其中，本基金管理人运用固有资金于 2010 年 11 月 4 日通过代销渠道认购的基金份额总额为 5,001,200.00 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 1.72%；本基金管理人的基金从业人员认购持有的基金份额总额为 1,397,992.42 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为 0.48%。按照有关法律规定，本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

根据《基金法》、《运作办法》和《基金合同》《招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2010 年 12 月 2 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 九、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

### （二）基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起十日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起十日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### （三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告；
- 3、在基金合同生效前，基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。
- 4、本基金的基金合同已于 2010 年 12 月 2 日正式生效。

### （四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后三十日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

### （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当向中国证监会说明原因及报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 十、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回办理的场所以

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告及代销机构的相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

上海证券交易所、深圳证券交易所以及香港商业银行、外汇市场及证券交易市场进行交易与清算支付同时开放的每个工作日为本基金的开放日（基金管理人依据法律法规或基金合同规定公告暂停申购、赎回时除外）。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人可视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效后不超过 3 个月开始办理。具体业务办理时间由基金管理人另行公告。

本基金的赎回自基金合同生效后不超过 3 个月开始办理。具体开放时间由基金管理人另行公告。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人于开始申购或赎回开始前 3 个工作日在指定媒介公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日的基金份额净值进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在前的基金份额先赎回，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；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日业务办理时间

结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日在指定媒介公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回申请的提出

投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项，否则所提交的申购申请无效。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效。

##### 2、申购与赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记人在 T+2 日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在 T+3 日（包括该日）后及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。否则，因投资者未及时进行该查询而造成的后果由其自行承担。

##### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 10 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1、基金管理人的网上交易系统每个账户首次申购的最低金额为 10 元人民币，单笔申购的最低金额为 10 元人民币；直销柜台每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元人民币，已在直销柜台有认/申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，单笔申购的最低金额为 10 元人民币；

2、基金份额持有人通过基金管理人网上交易系统或者直销柜台办理赎回时，可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 1 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。通过基金管理人网上交易系统或直销柜台赎回申请的最低份额为 10 份，但基金份额持有人单个交易账户内的基金份额余额少于 10 份并申请全部赎回时，可不受前述最低 10 份的申请限制。赎回申请的具体处理结果以注册登记中心确认结果为准；

3、除上述情况及另有公告外，基金管理人规定每个基金账户单笔最低申购金额为人民

币 1 元、单笔最低追加申购金额为人民币 1 元、单笔最低赎回份额为 1 份、单个基金账户最低持有份额为 1 份，各销售机构可根据情况设定最低申购金额、最低赎回份额以及最低持有份额，但不得低于本基金管理人设定的最低限制，具体以销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定；

4、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告；

5、基金管理人可根据市场情况，调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在 3 个工作日之前在指定媒介上刊登调整公告。

## （六）申购费与赎回费

### 1、申购费

本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。

| 申购金额（元）              | 申购费率     |
|----------------------|----------|
| 申购金额 < 50 万          | 1.6%     |
| 50 万 ≤ 申购金额 < 100 万  | 1.2%     |
| 100 万 ≤ 申购金额 < 200 万 | 1.0%     |
| 200 万 ≤ 申购金额 < 500 万 | 0.6%     |
| 申购金额 ≥ 500 万         | 1000 元/笔 |

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

### 2、赎回费

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

| 持有期限           | 赎回费率  |
|----------------|-------|
| 持有期 < 7 日      | 1.5%  |
| 7 日 ≤ 持有期 < 一年 | 0.5%  |
| 一年 ≤ 持有期 < 两年  | 0.25% |
| 持有期 ≥ 两年       | 0     |

本基金的赎回费用由赎回人承担，其中对持有期少于 7 日的赎回费全额计入基金财产，持有期不少于 7 日的赎回费不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记

费等相关手续费。

3、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

### （七）申购份额与赎回金额的计算

1、申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

各计算结果均按四舍五入的方法，保留至小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.6\%) = 49,212.60 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,212.60 = 787.40 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,212.60 / 1.05 = 46869.14 \text{ 份}$$

即：投资者投资 50000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到 46869.14 份基金份额。

2、投资者在赎回本基金时缴纳赎回费，投资者的净赎回金额为赎回金额扣除相应的费用的金额，其中，

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

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

各计算结果均按四舍五入的方法，保留至小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为三年，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日基金份额净值是 1.25 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.25 = 12,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500 \times 0\% = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500 - 0 = 12,500 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有期限为三年，假设赎回当日基金份额净值是 1.25 元，则其可得到的赎回金额为 12,500 元。

### 3、本基金份额净值的计算与披露

基金份额净值的计算,保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

$T$  日基金份额净值= $T$  日基金资产净值/ $T$  日登记在册的基金份额总数

基金管理人应在开放日后两个工作日内公告开放日的基金份额净值。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

## （八）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在  $T+2$  日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自  $T+3$  日起有权赎回该部分基金份额。

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

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介上公告。

## （九）巨额赎回的认定及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

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接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，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 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人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；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放

日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。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上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

（4）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介予以公告。

（5）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个或 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，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

#### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- （2）本基金主要投资市场的交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （4）本基金的资产规模达到中国证监会、外管局核准的境外证券投资额度；
- （5）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种；
- （6）其他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的情形；
- （7）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）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基金申购申请的措施；
- （9）法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述第（1）、（2）、（3）、（4）、（5）、（6）、（8）、（9）项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 本基金主要投资市场的交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生连续巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (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延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
- (6) 法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

### **(十一) 基金转换**

1、基金转换是在投资者按本公司规定条件将其所持有的本公司管理的一只基金份额转换为本公司管理的另一只基金份额的业务。需要办理基金转换的投资者须到原销售机构办理手续。本基金开通转换业务时，本公司将另行公告具体情况。

2、基金转换申请

以下内容尚未涵盖电子方式的基金转换，电子方式的基金转换选择参照本公司或代销机构各相关规则。

#### 个人投资者

个人投资者基金转换的申请，应当提供下列材料：

- (1) 有效身份证明文件原件及复印件；
- (2) 填妥的经本人签字确认的申请表。

委托他人代办的，还需提供委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。

#### 机构投资者

机构投资者基金转换的申请，应当提供下列材料：

- (1) 授权经办人有效身份证件文件原件及复印件；
- (2) 填妥的加盖预留印鉴章的申请表。

### 3、基金转换的规则

(1) 基金转换只能在同一销售机构办理，且该销售机构须同时代理转出基金及转入基金的销售；

(2) 基金转换以基金份额为单位进行申请，转换费计算采用单笔计算法。投资者在T日多次转换的，单笔计算转换费，不按照转换的总份额计算其转换费用；

(3) “定向转换”原则，即投资者必须指明基金转换的方向，明确指出转出基金和转入基金的名称；

(4) 基金转换采取“未知价法”，即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额资产净值为基准进行计算；

(5) 基金份额在转换后，持有人对转入基金的持有期自转入之日算起；

(6) 当某笔转换业务导致投资者基金账户内余额小于转出基金的基金合同和招募说明书中“最低持有份额”的相关条款规定时，剩余部分的基金份额将被强制赎回；

(7) 单个开放日基金净赎回份额及净转换转出申请份额之和超出上一开放日基金总份额的10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出视同基金赎回，基金管理人可根据基金资产组合情况决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延；

(8) 投资者办理基金转换业务时，转出基金必须处于可赎回状态，转入基金必须处于可申购状态；

(9) 转换业务遵循“先进先出”的业务规则，即首先转换持有时间最长的基金份额。如当日，同时有赎回申请的情况下，则遵循先赎回后转换的处理原则。

### (十二) 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

1、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，包括继承、捐赠、司法强制执行、基金注册登记机构认可的其他行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主

体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

“继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅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其他具有社会公益性质的社会团体；

“司法强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

2、办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，并向基金注册登记机构申请办理。

3、符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

4、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管可分一步或两步完成，具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构（网点）。

5、基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一律转为基金份额并冻结。

6、如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 十一、基金的费用和税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）；
- 3、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 4、基金合同生效以后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、基金的资金汇划费用；
- 8、基金进行外汇兑换交易的费用；
- 9、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.2%年费率计提。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人次月首日起 5 个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20%年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并发送基金托管费划付指令，基金托管人复核

后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### **（三）不列入基金费用的项目**

本条第（一）款约定以外的其他费用，基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### **（四）基金费用调整**

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### **（五）税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件在境内开立人民币和外币资金账户，在境外开立外币资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和境外托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人和境外托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金托管人和境外托管人应安全保管基金财产。

3、基金管理人、基金托管人、境外托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

4、基金托管人或境外托管人按照规定或境外市场惯例开设基金财产的所有资金账户和证券账户。

5、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。

6、基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对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范围。

7、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十三、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，确定基金资产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### （二）估值日

基金合同生效后，每个开放日对基金资产进行估值。

### （三）估值对象

本基金所持有的证券、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票的估值方法

（1）上市流通股票按估值日当日其所在证券交易市场的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### （2）未上市股票

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次公开发行的股票，按成本价估值。

非公开发行有明确锁定期的股票，按估值技术确定的公允价值估值。

#### 2、债券的估值方法

（1）对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

（2）对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值，其中成熟市场的债券按估值日的最近买价估值；新兴市场的债券按估值日的最近买价和卖价的均值估值。

#### 3、衍生工具：

（1）按估值日当日其所在市场的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定

公允价值。

#### 4、基金

(1) 上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日其所在交易所休市的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

5、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1-4 小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1-4 小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### 6、估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及人民币对主要外汇的汇率，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价；涉及其他货币对人民币的汇率，采用美元作为中间货币进行换算。

7、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人 and 基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果以书面形式发送基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的主要证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人、境外托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、中国证监会认定的其它情形。

### (七) 基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一开放日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。

基金份额净值的计算精确到 0.001 人民币元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条（四）估值方法中的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于交易机构或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化以及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，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，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。

## 十四、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未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 3、在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年至多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的 10%。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；
- 4、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至日）的时间不得超过 15 个工作日；
- 5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中至少应载明截至收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、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与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （六）收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额

持有人的现金红利按分红实施日的基金份额净值转为基金份额。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币为记账单位。
- 3、会计制度按国家有关的会计制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法規规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意。基金管理人应在更换会计师事务所后依照《信息披露办法》的有关规定披露。

## 十六、基金的信息披露

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、行政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”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

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、法人或者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。

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。

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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。

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基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## （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报刊和网站上登载基金合同生效公告。

## （四）基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在不晚于 T+2 日（T 日为开放日）通过指定网站、销售机构网站或者营业网点，披露开放日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 2 日，在指定网站披露半年度和年度最后一日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）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。

1、基金年度报告：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。

2、基金中期报告：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。

3、基金季度报告：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。

基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障

其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

### （七）临时报告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、 基金合同终止、基金清算；
- 3、 转换基金运作方式、基金合并；
- 4、 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、 基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 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、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、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 17、基金开始办理申购、赎回；
- 18、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、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、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、更换境外托管人；
- 22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）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。

#### （九）澄清公告

在基金合同期限内，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的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （十）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、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

#### **（十一）信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

#### **（十二）本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准。**

## 十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算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

组可以依法进行必要的民事活动。

### 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

### 4、清算费用

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

### 5、基金剩余财产的分配

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）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的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，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。

### 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 20 年以上。

## 十八、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2024年12月31日，中国银行已托管1125只证券投资基金，其中境内基金1059只，QDII基金66只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工

作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 十九、境外托管人

### （一）中银香港概况

名称：中国银行(香港)有限公司  
住所：香港中环花园道 1 号中银大厦  
办公地址：香港中环花园道 1 号中银大厦  
法定代表人：孙煜 总裁  
成立时间：1964 年 10 月 16 日  
组织形式：股份有限公司  
存续期间：持续经营  
联系人：黄晚仪 副总经理 托管业务主管  
联系电话：852-3982-6753

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）早于 1964 年成立，并在 2001 年 10 月 1 日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司（“中银香港(控股)”）-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2020 年末，中银香港(控股)有限公司的总资产超过 33,209 亿港元，资本总额超过 2,903 亿港元，总资本比率为 22.10%。中银香港(控股)的财务实力及双 A 级信用评级，可媲美不少大型全球托管银行，其最新信评如下(截至 2020 年 12 月 31 日)：

|      | 穆迪投资服务 | 标准普尔 | 惠誉国际评级 |
|------|--------|------|--------|
| 评级展望 | 稳定     | 稳定   | 稳定     |
| 长期   | Aa3    | A+   | A      |
| 短期   | P-1    | A-1  | F1+    |
| 展望   | 稳定     | 稳定   | 稳定     |

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础，且连续五年成为“亚太及香港区最稳健银行”《银行间杂志》。為貫徹中國銀行集團的海外發展戰略，中银香港積極推進區域化發展，拓展東南亞業務，分支機構遍及泰國、馬來西亞、越南、菲律賓、印度尼西亞、柬埔寨、老撾及文萊等東南亞國家，為當地客戶提供專業優質的金融服務，並加快建設成為一流的全功能國際化區域性銀行。透過與母行中國銀行的緊密聯動，中银香港為跨國公司、跨境客戶、內地「走出去」企業，以及各地央行和超主權機構客戶提供全方位及優質的跨境服務。

环球托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一，目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其各类产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产品之境外托管行，于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行，另于 2010 年服务市场首宗的跨境 QDII-ETF 等;至于服务境外机构客户方面亦成就显著：在“债券通”的领域 =>自开通至今，持续维持首五位的市场份额

在人民币合格境外机构投资者(RQFII)的领域 =>成为此类人民币产品的最大香港服务商

在离岸人民币 CNH 公募基金的领域 (2010 年 8 月) =>成为市场上首家服务商  
=>  
目前亦为最大的服务商

在港上市的交易所买卖基金(ETF) =>中资发行商的最大服务商之一

在离岸私募基金的领域 =>新募长仓基金的最大服务商之一

在非上市的股权/债权投资领域 =>香港少有的服务商之一

在“中港基金互认计划”领域 =>获得领先地位

在“香港上海黄金交易所(SGE)” =>任命为香港唯一结算银行

其业务专长及全方位的配备，令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行，亦是唯一获颁行业奖项的中资托管行：

专业杂志 所获托管奖项

亚洲投资人杂志服务提供商奖项

Asian Investors Service Providers Awards

最佳跨境托管亚洲银行 (2012)

Best Asian Bank for Cross-Border Custody (2012)

财资杂志托管专家系列奖项

The Asset Triple A Awards

最佳 QFII 托管行 (2013)

Best QFII Custodian (2013)

黄晚仪, 香港区年度托管银行家 (2014)

Fanny Wong, Custodian Banker of the Year, Hong Kong (2014)

最佳中国区托管专家 (2016)

Best Custody Specialist, China (2016)

中国最佳 QDII 托管行 (2018)

Best Custodian QDII, China (2018)

最佳 QDII 客户个案 (2018)

Best QDII Mandate (2018)

中国最佳 QDII 托管行 (2020)

Best Custodian QDII, China (2020)

高度推荐 - 中国最佳海外托管行 (2020)

Best Custodian, Highly Commended - Offshore, China  
(2020)

债券通有限公司 Bond Connect Company Limited

债券通优秀托管机构 (2018)

Bond Connect Best Custodian (2018)

债券通优秀托管行 (2019)

Bond Connect Best Custodian (2019)

债券通优秀托管行 (2020)

Bond Connect Best Custodian (2020)

截至 2020 年末, 中银香港(控股)的托管资产规模逾 13,717.6 亿港元。

## （二）托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

### 1、主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一，由管理委员会成员兼副总裁王兵先生直接领导。针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现时有二十多名骨干成员，职级均为经理或以上，分别主理结算、公司行动、账务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、营销、次托管网络管理及合规等方面。骨干人员均来自各大跨国银行，平均具备 20 年以上的专业托管工作经验(包括本地托管及全球托管)，并操流利普通话，可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理，中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队，以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外，若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务，则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司（“中银保诚”）提供。作为「强制性公积金计划管理局」认可的信托公司，中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务，其专职基金会计与投资监督人员达 50 多名，人员平均具备 10 年以上相关经验。

中银香港的管理层对上述服务极为重视，有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外，其它中/后台部门亦全力配合及支持托管服务的提供，力求以最高水平服务各机构性客户。

#### 关键人员简历

黄晚仪女士

托管业务主管

黄女士于香港大学毕业，并取得英国 Heriot-Watt University 的工商管理硕士及英国特许银行公会的会士资格。黄女士从事银行业务超过二十年，大部分时间专职于托管业务，服务企业及机构性客户。效力的机构包括曾为全球最大之金融集团 - 花旗集团 - 及本地两大发钞银行 - 渣打及中银香港。参加中银香港前，黄女士为花旗集团之董事及香港区环球托管业务总监。目前黄女士专职于领导中银香港的全球托管及基金服务发展，并全力配合中国合格境内机构投资者之境外投资及理财业务之所需，且担任中银香港集团属下多家代理人公司及信托公司的企业董事。黄女士亦热心推动行业发展，包括代表中银香港持续担任「香港信托人公会」行政委员会之董事一职、参与债券通智囊团的工作、出任港交所托管评议会的联席主席等，并曾先后获港交所委任作为其结算咨询小组成员，及担任香港证监会产品咨询委员会的委员。

郑丽华女士

托管运作及产品开发主管

郑女士乃英国特许公认会计师公会之资深会员及香港会计师公会之会员，并持有伦敦大学专业会计硕士学位。郑女士从事金融与银行业务超过二十年，其中十多年专职于托管

业务，服务企业及机构性客户。曾经工作的机构包括全球最大之金融集团 – 美国摩根大通银行与汇丰银行及本地银行 – 恒生银行，对托管业务操作、系统流程及有关之风险管理尤为熟悉。

阮美莲女士

财务主管

阮女士拥有超过二十年退休金及信托基金管理经验，管理工作包括投资估值、基金核算、投资合规监控及信托运作等。加入中银国际集团前，阮女士曾于百慕达银行任职退休金部门经理一职，以及于汇丰人寿任职会计经理，负责退休金基金会计工作。阮女士是香港会计师公会及英国特许公认会计师公会资深会员，并持有英国列斯特大学硕士学位。

## 2、安全保管资产条件

在安全保管资产方面，为了清楚区分管托客户与银行拥有的资产，中银香港目前已以托管人身份在本港及海外存管或结算机构开设了独立的账户以持有及处理客户的股票、债券等资产交收。

除获得客户特别指令或法例要求外，所有实物证券均透过当地市场之次托管人以该次托管人或当地存管机构之名义登记过户，并存放于次托管人或存管机构内，以确保客户权益。

至于在异地市场进行证券交割所需之跨国汇款，除非市场/存托机构/次托管行等另有要求，否则中银香港会尽可能在交收日汇入所需款项，以减少现金停留于相关异地市场的风险。

先进的系统是安全保管资产的重要条件。

中银香港所采用的托管系统名为”Custody & Securities System”或简称CSS，是中银香港聘用一支科技专家、并结合银行内部的专才，针对机构性客户的托管需求在原有的零售托管系统上重新组建而成的。CSS 整个系统构建在开放平台上，以 IBM P5 系列 AIX 运行。系统需使用两台服务器，主要用作数据存取及支持应用系统软件，另各自附有备用服务器配合。此外，一台窗口服务器已安装 NFS (Network File System, for Unix) 模块，负责与 AIX 服务器沟通。

新系统除了采用尖端科技开发，并融合机构性客户的需求与及零售层面的系统优势，不单符合 SWIFT-15022 之要求，兼容 file transfer 等不同的数据传输，亦拥有庞大的容量(原有的零售托管系统就曾多次证实其在市场买卖高峰期均运作如常，反观部分主要银行的系统则瘫痪超过 1.5 小时)。

至于基金估值、会计核算以及投资监督服务，则采用自行研发的 FAMEX 系统进行处理，系统可相容多种货币、多种成本定价法及多种会计算法，以满足不同机构客户及各类基金的需要。系统优势包括：多种货币；多种分类；实时更新；支持庞大数据量；简易操作，方便用户。系统所支持的核算方法包括：权重平均 (Weighted Average)；后入先出 (LIFO)；

先入先出(FIFO)；其它方法可经与客户商讨后实施。系统所支持的估值方法有：以市场价格标明(Marking to Market)；成本法；成本或市场价的较低者；入价与出价(Bid and offer)；分期偿还(Amortization)；含息或除息(Clean/dirty)；及其它根据证券类别的例外估值等。

### (三) 托管业务的主要管理制度

作为一家本地持牌银行，中银香港的业务受香港金融管理局全面监管；另外，作为本地上市的金融机构，中银香港亦需严格遵守香港联合交易所的规定及要求。

中银香港实施严格的内部控制制度和风险管理流程，所有重要环节均采用双人复核，减少人工操作风险；并由独立风险管理部门就任何新产品/服务/措施等进行全面评核及监控，避免人为失误或道德风险。任何外判安排，除上述风险分析外，还需寻求监管机构之批准。

对于次托管行或服务商的委任，中银香港亦制定了有关选任、服务标准、及日常服务水平监控等制度及要求，以确保服务质量。对托管客户而言，中银香港亦承担其次托管行之服务疏失等风险，并在托管合约中清楚订明。

中银香港具备经审核之应变计划以应付各种各样特殊情况的发生。应变计划每年均会进行测试及演练，模拟在突发情形下之业务运作，并对测试结果进行检讨及评估，以确保在突发情形下仍能提供服务。系统方面，灾难应变措施中心亦已预留独立应用软件及数据库服务器，随时取代生产服务器运作。

托管业务之规章制度及工作手册乃根据与托管相关的监管条例或指引(如：员工守则，了解你的客户政策、防洗钱政策及个人私隐条例等)与中银香港本身制定的内控制度(如：信息安全管理办法，包括托管系统用户之管理、权限之设定等)缮制，并因应有关条例、指引或政策之修订而适时调整，以确保符合对外、对内的监控要求。

有关托管业务的重要规章制度包括《托管业务标准操作规程》(Custody –Standard Operating Procedure Overview)，主要内容包括：账户开立、客户账户管理、结算程序、公司行动程序、资产核对、资金报告、账单、投诉、应急计划等等。以及《托管系统进入控制规程》(Custody –System Access Control Procedure Overview)，内容涵盖系统范围、系统描述、用户概况、功能列表、职责定义、增加、删除、修改程序、请求格式、系统控制与系统备份安排等。

中银香港设有独立的稽核委员会，直接向董事会负责，对各部门进行定期及不定期之稽核。至于年度审计，则委任安永(Ernst & Young)会计师事务所进行。在核心托管团队中，特设一名合规人员，专注负责托管业务的风险控制，确保实施全银行的合规标准。

中银集团系内各企业法人或业务条线均严格分开，并设严密的防火墙，以确保客户资

料高度保密。

#### **（四）重大处罚**

中银香港托管业务自成立至今已超过十四年，从未受到监管机构的重大处罚，亦没有重大事项正在接受司法部门、监管机构的立案调查。

## 二十、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

电话：（021）38601777

传真：（021）50103016

联系人：汪莹白

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：www.huatai-pb.com

#### 2、代销机构

本基金代销机构信息详见基金管理人网站公示。

3、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本基金，并及时在基金管理人网站公示。

### （二）注册登记机构

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

电话：（021）38601777

传真：（021）50103016

联系人：赵景云

### （三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层

负责人：王玲

联系电话：021-24126000

传真：021-24126150

经办律师：靳庆军、傅轶

联系人：傅轶

**（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）

注册地址：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

经办注册会计师：许培菁、张亚旎

联系人：许培菁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

## 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

#### 1、基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金份额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、基金合同规定的其它权利。

#### 2、基金份额持有人的义务

- （1）遵守法律法规、基金合同；
- （2）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- （3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；
- （5）执行基金份额持有人大会的决议；
- （6）返还在基金交易过程中，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- （7）基金份额持有人应遵守基金管理人及其代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- （8）法律法规及基金合同规定的其他义务。

#### 3、基金管理人的权利

- （1）依法申请并募集基金，办理基金备案手续；
- （2）依照法律法规和基金合同运用基金财产；
- （3）自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；

(5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；

(6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银保监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(17) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(18) 选择、更换基金境外投资顾问，委托境外投资顾问协助投资管理等业务；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

#### 4、基金管理人的义务

(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) 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；

(3) 办理基金备案手续；

(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、分别记帐，进

行证券投资；

- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (12) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料；
- (17) 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；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因过错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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 基金管理人对其委托的投资顾问及其他第三方机构的行为承担责任。
- (23) 中国证监会规定的其他职责。

## 5、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 选择、更换境外托管人并为之签署有关协议；

(7) 在法律法规许可的范围内，可以用基金合同项下基金对基金托管人所负的任何已经到期的付款义务抵销基金托管人在基金合同项下对基金所负已经到期的付款义务，而不论各项义务的付款地和币种；

(8) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 6、基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产；

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

(3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益；

(5) 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和独立；

(6) 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；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 按照有关法律法规和基金合同的约定，执行基金管理人投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；

(12) 保存基金份额持有人名册；

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

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；

(19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(20) 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；

(21) 按照有关法律法规、基金合同的规定以受托人名义或其指定的代理人名义登记资产；

(22) 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；

(23) 基金托管人应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；

(24) 基金托管人应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；

(25) 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**

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(4) 更换基金管理人、基金托管人；

(5) 变更基金类别；

(6) 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）；

(7) 变更基金份额持有人大会程序；

(8) 本基金与其它基金合并；

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

(10) 法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况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) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(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；

(6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

#### 4、召集方式：

(1) 除法律法规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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上（“以上”含本数，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### 5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点、方式；

(2) 会议拟审议的主要事项；

(3) 代理投票委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、授权范围、授权的有效期限等）、送达时间和地点；

(4) 会务常设联系人姓名、电话；

(5) 权益登记日；

(6) 如采用通讯表决方式, 则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

## 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 基金管理人或基金托管人不派代表出席的, 不影响表决效力; 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定, 但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定;

(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, 全部有效凭证所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)。

在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:

(1) 召集人按基金合同规定公告会议通知后, 在两个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2) 召集人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;

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50% (含 50%);

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表, 同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定;

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系, 并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的, 应提交大会审议; 对于

不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

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

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

5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (2) 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

### 2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当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，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

(3) 采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 9、计票

### (1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，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中推举三名基金份额持有人担任监票人。

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

4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

## 10、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》有关规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒介公告。

(4) 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### （三）基金收益分配原则、执行方式

#### 1、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。

#### 2、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未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### 3、收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。

（1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；

（2）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

（3）在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年至多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的 10%。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

（4）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至日）的时间不得超过 15 个工作日；

（5）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（6）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 4、收益分配方案

基金收益分配方案中至少应载明截至收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 5、收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

#### 6、收益分配中发生的费用

（1）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

（2）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红实施日的基金份额净值转为基金份额。

### （四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

- (2) 基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）；
- (3) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (4) 基金合同生效以后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的资金汇划费用；
- (8) 基金进行外汇兑换交易的费用；
- (9) 与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- (10) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.8% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人次月首日起 5 个工作日内将上月基金管理费的计算结果通知基金托管人并发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### (2) 基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.35% 年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第 1 款第 (3) 至第 (10) 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

## 3、不列入基金费用的项目

本条第 1 款约定以外的其他费用，基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### 4、基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

#### 5、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

### （五）基金财产的投资范围和投资限制

#### 1、投资范围

本基金可投资于下列金融产品或工具：权益类品种，包括普通股、优先股、全球及美国存托凭证、股票型基金等；固定收益类品种，包括政府债券、公司债券、可转换债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的固定收益类证券；银行存款、回购协议、短期政府债券与货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资的股票占基金资产的比例不低于 60%；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于 40%，其中，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金不低于 80%的权益类资产将投资于亚洲领导企业。亚洲领导企业是指在亚洲地区证券市场进行交易或至少 50%的主营业务收入来自于亚洲地区而在亚洲以外交易所上市的企业，同时具有较高的市场占有率和盈利能力、卓越的研发和生产能力、先进的市场营销手段和网络、核心的品牌优势和资源储备、科学的公司治理、创新的商业模式、良好的企业管理团队等要素的，能够为股东带来超额收益的上市公司。

#### 2、投资限制

（1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，但存放于托管行的存款除外；

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

（3）本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市值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市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本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。同一境内机构投资者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；

(5) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%；

前项非流动性资产是指法律或本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) 同一境内机构投资者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%；

(7) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制；

(8) 本基金投资的股票占基金资产的比例不低于 60%；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于 40%；

(9) 本基金投资现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；

(10) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于本基金资产净值的 100%；

(11) 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%；

(12) 本基金投资金融衍生品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%；

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

(14) 本基金境内投资还应遵守以下限制：

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

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本款投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整；

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

(15) 相关法律法规、基金合同及中国证监会的其他规定。

### 3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 购买不动产；
- (2) 购买房地产抵押按揭；
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (4) 购买实物商品；
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%；
- (6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (8) 从事证券承销业务；
- (9) 向他人贷款或者提供担保；
- (10) 从事承担无限责任的投资；
- (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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人、境外托管人发行的股票或者债券；
- (13) 买卖与其基金管理人、基金托管人、境外托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (14) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (15) 不公平对待不同客户或不同投资组合；
- (16) 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料；
- (17) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## **(六) 基金资产净值的计算**

### **1、估值目的**

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，确定基金资产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### **2、估值日**

基金合同生效后，每个开放日对基金资产进行估值。

### **3、估值对象**

本基金所持有的证券、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

### **4、估值方法**

#### **(1) 股票的估值方法**

1) 上市流通股票按估值日当日其所在证券交易市场的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2) 未上市股票

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次公开发行的股票，按成本价估值。

非公开发行有明确锁定期的股票，按估值技术确定的公允价值估值。

(2) 债券的估值方法

1) 对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

2) 对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值，其中成熟市场的债券按估值日的最近买价估值；新兴市场的债券按估值日的最近买价和卖价的均值估值。

(3) 衍生工具：

1) 按估值日当日其所在市场的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2) 未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

(4) 基金

1) 上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日其所在交易所休市的，以最近交易日的收盘价估值。

2) 其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

(5) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1) - (4)小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1) - (4)小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及人民币对主要外汇的汇率，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价；涉及其他货币对人民币的汇率，采用美元作为中间货币进行换算。

(7) 国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

5、估值程序

基金日常估值由基金管理人、基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果以书面形式发送基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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。

#### 6、暂停估值的情形

- (1) 基金投资所涉及的主要证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (2) 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人、境外托管人无法准确评估基金财产价值时；
- (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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- (4) 中国证监会认定的其它情形。

#### 7、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一开放日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。

基金份额净值的计算精确到 0.001 人民币元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### 8、估值错误的处理

- (1) 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。
- (2) 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。
- (3) 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### 9、特殊情形的处理

- (1) 基金管理人按本条 4 估值方法中的第（5）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。
- (2) 由于交易机构或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化以及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，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，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。

## （七）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的。

（2）变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（3）但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- （3）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### 3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

#### （2）基金财产清算组

1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### （3）清算程序

- 1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;
- 4) 对基金财产进行评估和变现;
- 5) 制作清算报告;
- 6) 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;
- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- 8) 对基金财产进行分配。

#### (4) 清算费用

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

#### (5) 基金剩余财产的分配

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)、2)、3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### (6) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的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, 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。

- (7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 20 年以上。

### (八) 争议的处理

- 1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。
- 2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起 60 日内未能以协商方式解决的, 则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会, 根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。
- 3、除争议所涉内容之外, 本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### (九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

- 1、本基金合同正本一式六份, 除上报有关监管机构二份外, 基金管理人、基金托管人各持二份, 每份具有同等的法律效力。

2、基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资者查阅，基金合同条款及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）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

(1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化, 对各投资品种的具体范围予以更新和调整, 并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督;

(2) 对基金投融资比例进行监督;

其中, 基金托管人根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对投资组合的比例做如下监督:

1) 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

2) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致; 本基金管理人承诺本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致, 并承担由于不一致所导致的风险和损失;

3) 本基金境内投资应遵守以下限制:

① 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%; 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本款投资比例的, 基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整;

② 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(3) 对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督, 基金管理人和基金托管人应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, 基金托管人和基金管理人均有责任保证该名单的真实、准确和完整性, 并及时将更新后的名单发送给对方;

(4) 基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库, 交易对手库由信用等级符合《通知》要求的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化, 及时对交易对手库予以更新和调整, 并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时, 交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督;

(5) 基金如投资银行存款, 基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定, 事先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, 基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督;

(6) 对法律法规规定及基金合同中实际可以监控事项约定的基金投资的其他方面进行监督。

2、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、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业务监督、核查。

3、基金托管人发现基金管理的违规行为，应及时通知基金管理人，由基金管理人在违规后 30 个工作日内纠正；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的，基金托管人应报告中国证监会。

4、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：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。

5、基金托管人对投资管理人对基金资产的投资运作于估值日结束且相关数据齐备后，进行交易后的投资监控和报告。

6、基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性受限于基金管理人及其他中介机构提供的数据和信息，基金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。

7、基金托管人对基金管理人的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

### (三) 基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，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基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、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、无正当理由未执行或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法律法规、基金合同及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、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）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、基金合同及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的所有资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。
- （6）现金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有。
- （7）托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例，支付现金、办理证券登记等托管业务。

##### 2、基金募集期间及募集资金的验资

- （1）基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。
- （2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合基金合同及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。验资完成后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立并指定的基金托管银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。
- （3）若基金募集期限届满，未能达到基金合同及其他有关规定的生效条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

##### 3、基金银行账户的开立和管理

- （1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- （2）基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。
- （3）本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
- （4）基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

#### 4、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的交易所或登记结算机构或境外资产托管人处，按照该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户。

（2）基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及各自委托代理人均不得出借擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金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）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）基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

#### 5、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，由基金托管人或境外资产托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

（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。

#### 6、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有价凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。基金托管人对其及境外托管人确有必要或依据交易习惯需要委托其他机构持有的，基金托管人对其及境外托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 7、与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

基金资产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行。

#### 1、基金资产定价

基金托管人、境外托管人负责按基金管理人和基金托管人约定的定价原则对基金资产

进行定价。在进行资产定价时，基金托管人、境外托管人有权本着诚意原则，依赖经纪人、定价服务机构或其他机构的定价信息，但在不存在过错的前提下，基金托管人、境外托管人对上述机构提供的信息的准确性和完整性不作任何担保，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的基金管理人或基金财产损失不负任何责任。

## 2、基金财产净值的计算和复核

### （1）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指基金财产净值除以基金份额总数后的价值。

### （2）复核程序

基金管理人每个开放日对基金进行估值，估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。每一工作日上午 12:00 之前，基金管理人将前一开放日的基金估值结果以书面形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在当日 18:00 之前盖章或签字后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（3）当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

（5）当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应向中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

（6）如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在偏差并且偏差在合理的范围内，基金份额净值以基金管理人的计算结果为准，基金管理费和基金托管费也应以基金管理人的净值计算结果计提。

（7）由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人

已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

（8）由于证券交易所及其登记结算公司及其他中介机构发送的数据错误，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，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和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。

（9）如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

### 3、基金会计核算

#### （1）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

#### （2）会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

#### （3）基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《基金合同》生效后，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，更新招募说明书并登载在指定网站上。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招募说明书和基金产品资料概要。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。基金合同生效不足两个月的，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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完

成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

#### **（六）基金份额持有人名册的保管**

##### **1、基金份额持有人名册的内容**

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

##### **2、基金份额持有人名册的提供**

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

##### **3、基金份额持有人名册的保管**

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、基金合同和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行基金合同和本

协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

### **（七）争议解决方式**

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应各自继续履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

### **（八）托管协议的修改、终止与基金财产的清算**

#### **1、托管协议的修改程序**

本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

#### **2、基金托管协议终止出现的情形**

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金合同终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

#### **3、基金财产的清算**

基金管理人和基金托管人应按照基金合同及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售机构及销售机构提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

### （一）网上开户及交易服务

机构投资者可通过基金管理人直销柜台，个人投资者可通过基金管理人网站或 APP 客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

### （二）账户及信息查询服务

机构投资者通过基金管理人网站，个人投资者通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端，可享受基金交易查询、账户查询和基金管理人依法披露的各类基金信息等服务，包括基金产品基本信息（包括基金名称、管理人名称、基金代码、风险等级、持有份额、单位净值等）、基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

### （三）账单及资讯服务

#### 1、对账单服务

基金管理人通过电子邮件形式向投资者定期发送交易电子邮件对账单（包括基金名称、基金代码、持有份额等基金保有情况信息），电子邮件地址不详及退订的除外。

#### 2、资讯服务

投资者知悉并同意基金管理人不定期通过电话、短信、邮件、微信等方式提供与投资者相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息等资讯服务。如需取消相应资讯服务，可按照相关指引退订，或通过基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001、在线客服等人工服务方式退订。

### （四）客户服务中心电话及在线服务

#### 1、电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001 可享受如下服务：

（1）自助语音服务（7×24 小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。

(2) 人工服务：提供交易日上午 9：00-11：30 下午 13：00-17：30 的人工服务。投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

## 2、在线服务

投资人通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端提供交易日上午 9：00-11：30 下午 13：00-17：30 的在线服务人工服务。投资人可通过该方式获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

## (五) 投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

## (六) 联系基金管理人

- 1、网址：www.huatai-pb.com
- 2、客服邮箱：cs4008880001@huatai-pb.com
- 3、客服热线：400-888-0001（免长途话费），或 021-38784638
- 4、传真：021-50103016
- 5、联系地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

(七) 如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请及时通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。

## 二十四、其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2024 年 06 月 28 日至 2025 年 06 月 27 日），下列公告在指定媒介披露：

| 公告名称                                                             | 披露日期       |
|------------------------------------------------------------------|------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告                               | 2025-06-04 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金限制大额申购（含定期定额投资）业务的公告                          | 2025-05-27 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)有限公司办理旗下基金相关业务公告                       | 2025-05-24 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告                      | 2025-05-14 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                        | 2025-05-10 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                        | 2025-05-01 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金限制大额申购(含定期定额投资)业务的公告                          | 2025-04-24 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告                               | 2025-04-22 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2024 年年度报告                                   | 2025-03-31 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金更新的招募说明书 2025 年第 1 号                          | 2025-02-08 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                                    | 2025-02-07 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金调低管理费率 and 托管费率并修改基金合同和托管协议的的公告 | 2025-02-06 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告                               | 2025-01-22 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年底及 2025 年非港股通交易日暂停申购赎回等业务安排的公告        | 2024-12-26 |
| 华泰柏瑞基金管理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           | 2024-12-19 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告                           | 2024-11-18 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告                                     | 2024-11-02 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告                               | 2024-10-25 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告                               | 2024-09-27 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告                           | 2024-09-19 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告                       | 2024-09-04 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2024 年中期报告                                   | 2024-08-31 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务公告                     | 2024-08-16 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告                                      | 2024-07-24 |

|                                          |            |
|------------------------------------------|------------|
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告  | 2024-07-19 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告       | 2024-07-19 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                | 2024-07-13 |
| 华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金更新的招募说明书 2024 年第 1 号  | 2024-07-13 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告 | 2024-07-06 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                | 2024-07-03 |

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

- （一）中国证监会核准华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金募集的文件
- （二）《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

以上第（一）至（五）项备查文件存放在基金管理人办公场所、营业场所，第（六）项文件存放于基金托管人的办公场所。基金投资者在营业时间可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二五年九月十三日