

汇添富恒生指数分级证券投资基金  
更新招募说明书  
(2014 年第 1 号)

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2013 年 9 月 25 日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1247 号文核准募集。本基金基金合同于 2014 年 3 月 6 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金主要投资于香港证券市场，基金净值会因为香港证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，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、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、汇率风险；基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险；由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险；本基金的特定风险、分级份额投资者特有的风险等。（详见本招募说明书“风险揭示”章节）。本基金属于股票型基金，其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外，本基金作为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。恒生 A 份额具有低风险、低预期收益的特征；恒生 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。由于本基金投资的恒生指数成分股在香港交易所上市交易，根据香港交易所对于股票价格涨跌幅不设限制的交易规则，添富恒生的份额净值每日涨跌幅亦不受限制，故本基金的预期风险、预期收益较当前沪深交易所上市交易的普通股票指数型基金更大。特别的，当恒生指数发生日内巨幅下跌，以致恒生 B 份额的参考净值跌至负值的情况下，恒生 B 份额投资者损失所有本金，剩余亏损由恒生 A 份额投资者承担。即恒生 B 份额较基础份额（添富恒生）的风险更大。而基于以上风险条件，具有固定收益特性的恒生 A 份额既不保证收益也不保证本金不受亏损，风险小于基础份额，高于当前深圳证券交易所运行的普通股票型分级证券投资基金的稳健收益份额。

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

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为 2014 年 9 月 6 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 6 月 30 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪言	5
二、释义	6
三、基金的风险揭示	13
四、基金的投资	20
五、基金的业绩	36
六、基金管理人	37
七、基金份额的分类和净值计算规则	50
八、基金的募集	54
九、基金合同的生效	60
十、恒生 A 份额与恒生 B 份额的上市与交易	61
十一、添富恒生基金份额的申购与赎回	63
十二、基金的认购、申购和赎回等业务的代理	74
十三、基金份额的系统内转托管、跨系统登记等其他业务	75
十四、基金份额的配对转换	77
十五、基金的财产	79
十六、基金资产的估值	81
十七、基金的收益分配	87
十八、基金的费用与税收	89
十九、基金份额的折算规则	92
二十、基金的会计与审计	104
二十一、基金的信息披露	105
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	111
二十三、基金托管人	114
二十四、境外托管人	121
二十五、相关服务机构	122
二十六、基金合同的内容摘要	145
二十七、基金托管协议的内容摘要	163
二十八、对基金份额持有人的服务	175
二十九、其他应披露事项	176

三十、招募说明书的存放及查阅方式	179
三十一、备查文件	180

## 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称《通知》）及其他有关法律法规以及《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》编写。

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

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指汇添富恒生指数分级证券投资基金
- 2、基金管理人：指汇添富基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、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
- 5、基金合同或本基金合同：指《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书：指《汇添富恒生指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 8、基金份额发售公告：指《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、上市交易公告书：在本基金分级运作期内，指《汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A 份额和恒生 B 份额上市交易公告书》；本基金分级运作终止转换为上市开放式基金（LOF）后，指《汇添富恒生指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日

实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《试行办法》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日颁布、同年 7 月 5 日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

16、《通知》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日公布的《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》

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

19、外管局：指国家外汇管理局或其授权的派出机构

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

21、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

22、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

23、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

24、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

25、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

27、销售机构：指汇添富基金管理股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销



售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

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

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

30、基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，基金投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

31、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户，基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统；

32、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人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变动及结余情况的账户

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

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

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

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所以及境外主要投资场所的共同交易日

38、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的

## 开放日

39、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

40、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

42、《业务规则》：指《汇添富基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》、深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

43、基金份额分级：指本基金的基金份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额、汇添富恒生指数分级证券投资基金之 A 份额与汇添富恒生指数分级证券投资基金之 B 份额。其中，汇添富恒生指数分级证券投资基金之 A 份额与汇添富恒生指数分级证券投资基金之 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变；

44、添富恒生份额：指分级运作期内的本基金之基础份额，以及分级运作终止转换为上市开放式基金（LOF）后本基金的基金份额

45、恒生 A 份额：指本基金之基础份额自动分离或者分拆的稳健收益类基金份额

46、恒生 B 份额：指本基金之基础份额自动分离或者分拆的积极收益类基金份额

47、恒生 A 份额的本金：除非基金合同文义另有所指，对于恒生 A 份额而言，指 1.00 元

48、子份额：恒生 A 份额或恒生 B 份额

49、两级子份额：指恒生 A 份额和恒生 B 份额

50、恒生 A 份额/恒生 B 份额参考净值：指本基金分级运作期内，在 T 日添富恒生份额净值计算的基础上，按照本基金合同约定的参考净值计算规则计算得到的 T 日恒生 A 份额/恒生 B 份额估算价值

51、恒生 A 份额约定年基准收益率：恒生 A 份额约定年基准收益率为“同

期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3.00%”。但基金管理人并不承诺或保证恒生 A 份额持有人的该等收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，恒生 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益的风险甚至损失本金的风险

52、恒生 A 份额累计约定应得收益：恒生 A 份额依据约定年基准收益率及基金合同约定的截至计算日的实际天数计算的累计收益

53、标的指数：恒生指数。

54、场外：指不通过深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回的销售机构和场所

55、场内：指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位及深圳证券交易所交易系统进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的深圳证券交易所会员单位和场所

56、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

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

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

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

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

61、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

62、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为

63、日/天：指公历日

64、月：指公历月

65、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统

66、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统

67、上市交易：在本基金分级运作期内，指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖恒生 A 份额和恒生 B 份额的行为；本基金分级运作终止转换为上市开放式基金（LOF）后，指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖添富恒生份额的行为

68、自动分离：指投资人在场内认购的每 2 份添富恒生份额在发售结束后按 1: 1 比例自动转换为 1 份恒生 A 份额和 1 份恒生 B 份额的行为

69、配对转换：指本基金添富恒生份额的场内份额与恒生 A 份额、恒生 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并

70、分拆：根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 2 份添富恒生份额的场内份额申请转换成 1 份恒生 A 份额与 1 份恒生 B 份额的行为

71、合并：根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每 1 份恒生 A 份额与 1 份恒生 B 份额申请转换成 2 份添富恒生份额的场内份额的行为

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

73、巨额赎回：指添富恒生份额单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%。

74、元：指人民币元

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

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

77、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

78、两级子份额净资产：指恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额参考净值

乘以各自的份额数之和

79、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

80、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

81、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

82、不可抗力：指基金本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金的风险揭示

本基金将主要面临以下风险，其中部分或全部风险因素可能对基金份额净值、收益率、和 / 或实现投资目标的能力造成影响。

#### （一）本基金的特别风险

##### 1、指数下跌风险

本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

##### 2、跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

（1）基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

（2）指数成份股派发现金红利等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

（3）当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（4）投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（5）在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

（6）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不相同；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

##### 3、流动性风险

(1) 本基金最小申购、赎回单位设置较高，且在分级运作期间，中小投资者不能通过二级市场卖出添富恒生份额，故添富恒生份额投资者存在流动性风险。

(2) 由于本基金为投资香港市场的指数基金，T 日申购的基金份额在 T+2 日才可以卖出或赎回，存在基金份额不能及时变现的风险。

#### 4、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

#### 5、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等原因可能引致风险，例如，越权违规交易、欺诈行为、交易错误、IT 系统故障等风险。

在基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、境外资产托管人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### (二) 持有本基金分级份额的投资者还将面临如下风险。

#### 1、三类基金份额的风险特征

本基金的基础份额为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

恒生 A 份额将具有低风险、收益稳定特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额，类似于债券型基金份额。

恒生 B 份额则具有高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额，类似于具有收益杠杆性的股票型基金份额。但由于本基金的收益分配将优先满足恒生 A 的收益分配，为避免恒生 B 的份额参考净值跌到零，本基金采取了基金份额到点折算机制，在本基金资产出现极端损失情况下，则恒生 A 基金份额也可能面临投资本金亏损。

#### 2、恒生 A 份额实现约定收益过程中的风险

本基金在转化为普通 LOF 基金运作前将不进行收益分配，但是根据基金合同的约定，在基金份额折算日，基金管理人将依据《基金合同》的约定办理添富恒生份额与恒生 A 份额、恒生 B 份额之间的份额配对转换业务。恒生 A 份额的投资者可通过赎回恒生 A 的新增添富恒生场内份额的方式获取投资回报，但是，该获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额赎回的价格波动风险。

### 3、份额配对转换业务中存在的风险

本基金《基金合同》生效后，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理添富恒生份额与恒生 A 份额、恒生 B 份额之间的份额配对转换业务。一方面，这一业务的办理可能改变恒生 A 份额与恒生 B 份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，这一业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

### 4、流动性风险

在本基金基金份额上市交易后，恒生 A 份额与恒生 B 份额的规模可能较小或交易量不足，导致投资者不能迅速、低成本地变现或买入的风险。

在基金份额折算期间，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停恒生 A 份额与恒生 B 份额的上市交易和添富恒生份额的申购或赎回等业务，投资者的基金份额可能面临不能变现的风险。

此外，基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止；此外基金投资于香港市场，香港市场的突发性情况也可能对本基金的交易产生影响。

### 5、基金份额的折/溢价交易风险

本基金的分级份额在证券交易所上市，受标的指数走势、市场供求关系、投资者的预期差异和基金份额配对转换套利机制等因素的影响，本基金的两级份额可能会面临偏离其份额净值的风险。

### 6、一年期定存利率变动的风险

恒生 A 份额约定年基准收益率为“1 年期同期银行定期存款利率（税后）+3.0%”，1 年期同期银行定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。如果期间出现利率上调，恒生 A 的收益



率并不会立即进行调整，而是等到下一个1月1日再根据实际情况作出调整，从而出现利率风险。

### （三）境外投资风险

#### 1、汇率风险

本基金以人民币募集和计价，经过换汇后主要投资于香港市场以港币计价的金融工具。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。

此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

#### 2、市场风险

基金投资将受到香港市场宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。

#### 3、法律和政治风险

由于香港市场适用不同法律法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。此外，香港市场可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、没收资产以及征收高额税收等，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

#### 4、会计制度风险

香港市场对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定可能与境内存在一定差异，可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差，从而给本基金投资带来潜在风险。

#### 5、税务风险

香港市场在税务方面的法律法规可能与境内存在一定差异，可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。此外，香港市场的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力

的修订，从而导致基金向该市场所在地缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

#### 6、基金托管人/境外托管人风险

基金托管人/境外托管人风险是指基金托管人/境外托管人在托管基金的过程中，由于各种原因，在资产保管、资金清算、报表编制等方面出现失误，导致基金资产受到损失。

本基金将本着谨慎的原则按照中国证监会的要求谨慎严格地选择基金托管人/境外托管人来降低风险。

### （四）投资工具的相关风险

#### 1、股票

股票投资风险主要包括：货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；市场挂牌交易的上市公司经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

#### 2、债券

债券投资风险主要包括：市场利率水平变化导致债券价格变化的风险；债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量下降导致债券价格下降的风险。

#### 3、衍生品

由于金融衍生产品具有杠杆效应，价格波动较为剧烈，在市场面临突发事件时，可能会导致投资亏损高于初始投资金额，从而对基金收益带来不利影响。此外，衍生品的交易可能不够活跃，在市场变化时，可能因无法及时找到交易对手或交易对手方压低报价，导致基金资产的额外损失。

#### 4、正回购/逆回购

在回购交易中，交易对手方可能因财务状况或其他原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响。

#### 5、证券借贷

作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失。

### （五）政策变更风险

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

### （六）不可抗力风险

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、代理机构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。

### （七）声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构销售，但是，本基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

3、恒生指数（“该指数”）由恒生指数有限公司根据恒生资讯服务有限公司的授权发布及编制。恒生指数的商标及名称由恒生资讯服务有限公司全权拥有。恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司已同意汇添富基金管理股份有限公司可就汇添富恒生指数分级证券投资基金（“该产品”）使用及参考该指数，但是，恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司并不就（i）该指数及其计算或任何与之有关的数据的准确性或完整性；或（ii）该指数或其中任何成份或其所包涵的数据的适用性或适合性；或（iii）任何人士因使用该指数或其中任何成份或其所包涵的数据而产生的结果，而向该产品的任何经纪或该产品持有人或任

何其他人士作出保证或声明或担保，也不会就该指数提供或默示任何保证、声明或担保。恒生指数有限公司可随时更改或修改计算及编制该指数及其任何有关的公式、成份股份及系数的过程及基准，而无须作出通知。在适用法律允许的范围内，恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司不会因（i）汇添富基金管理股份有限公司就该产品使用及/或参考该指数；或（ii）恒生指数有限公司在计算该指数时的任何失准、遗漏、失误或错误；或（iii）与计算该指数有关并由任何其他人士提供的资料的任何失准、遗漏、失误、错误或不完整；或（iv）任何经纪、该产品持有人或任何其他交易该产品的人士，因上述原因而直接或间接蒙受的任何经济或其他损失承担任何责任或债务，任何经纪、该产品持有人或任何其他交易该产品的人士不得因该产品，以任何形式向恒生指数有限公司及/或恒生资讯服务有限公司进行索偿、法律行动或法律诉讼。任何经纪、持有人或任何其他人士，须在完全了解此免责声明，并且不能依赖恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司的情况下交易该产品。为避免产生疑问，本免责声明不构成任何经纪、持有人或任何其他人士与恒生指数有限公司及/或恒生资讯服务有限公司之间的任何合约或准合约关系，也不应视作已构成这种关系。任何投资者如认购或购买该产品权益，该投资者将被视为已承认、理解并接受此免责声明并受其约束，以及承认、理解并接受该产品所使用之该指数数值为恒生指数有限公司酌情计算的结果。

## 四、基金的投资

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。

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

### （三）投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

#### 1、组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

#### 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份股足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代。

#### 3、衍生品投资策略

由于本基金申购赎回采取现金方式，考虑到申购赎回资金流动冲击以及外汇汇兑、资金划转的操作问题，基金将会保留一定的现金头寸用于满足赎回及香港

证券交收要求。现金头寸的增加将导致跟踪误差的扩大，因此基金管理人将通过投资以标的指数为基础资产的衍生产品（如期货、掉期等）以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

未来，随着投资工具的发展和丰富，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

#### （四）投资决策机制和程序

##### 1、投资决策依据

- （1）国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；
- （2）标的指数的相关规定；
- （3）《汇添富基金管理股份有限公司章程》的有关规定；
- （4）《汇添富基金管理股份有限公司投资管理制度》的有关规定。

##### 2、投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

（1）投资决策委员会的主要职能：

本基金管理人设立的投资决策委员会是本基金投资的最高决策机构。投资决策委员会的主要职责包括：

- 1) 负责决定有关指数重大调整的应对决策；
- 2) 负责决定其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；
- 3) 审核评估基金经理每季提交的投资运作季报。

（2）基金经理的主要职责

基金经理的主要职责包括：

1) 决定正常市场情况下，日常指数跟踪过程中的组合构建、调整决策以及日常管理等工作；

- 2) 必要时进行本基金跟踪偏离的分析；
- 3) 每季向投资决策委员会提交本基金的投资运作季报；
- 4) 撰写基金中报、年报等公开报告关于基金投资运作的相关部分。

##### 3、投资决策程序

本基金投资程序分为投资研究、投资决策、投资执行(组合构建与监控调整)、交易执行、投资绩效评估、投资核对与监督、组合监控与调整、投资风险管理八个环节。

#### (1) 研究支持

指数投资管理小组依托基金管理人整体研究平台,整合内外部的信息和研究成果,开展对标的指数的跟踪研究、对标的指数成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、对标的指数成份股流动性分析、对基金的跟踪误差及时进行归因分析等工作,并撰写相关研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

#### (2) 投资决策

投资决策委员会依据指数投资管理小组提供的研究报告,定期或遇重大事项时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理在投资决策委员会决议的基础上,进行基金投资管理的日常决策。

定期事项是指:每季初投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策,基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作;

#### (3) 投资执行(组合构建与监控调整)

根据标的指数,结合指数投资管理小组的研究报告,基金经理以完全复制标的指数的方法构建组合。在跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,降低买入成本、控制投资风险。

#### (4) 交易执行

集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5) 风险监控:风险控制人员根据实时风险监控系統,在交易期间对指数基金各类风险源进行监控,一旦发现异常立即通知基金经理,基金经理将根据风险的具体情况,确定相应的应急操作方案。

#### (6) 投资绩效评估

金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估将确认组合是否实现了投资预期、对跟踪误差和业绩偏离的来源进行分析,基金经理可以据此检视投资策略,进而调整投资组合。

- 1) 不定期的,基金经理对基金出现的较大的跟踪偏离进行及时分解和分析;
- 2) 每周末,数量分析师对本基金的运行情况量化评估;

3) 每月末, 基金经理根据评估报告分析当月的投资操作和跟踪指数的偏离情况, 主要对组合跟踪偏离和跟踪误差、现金控制情况、成份股更新期的投资操作以及成份股未来可能发生的变化进行分析并提供相关报告, 作为今后投资运作的参考依据。

在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### (7) 投资核对与监督

基金营运部基金会计通过交易数据的核对, 对当日交易操作进行复核, 如发现有违反《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》、公司相关管理制度的交易操作, 须立刻向投资总监汇报, 并同时通报督察长、稽核监察部及基金经理。

集中交易室负责对基金投资的日常交易行为进行实时监控。

督察长和稽核监察部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查, 有权调阅任何数据和资料, 防止在投资管理过程中的违规风险。

#### (8) 投资风险管理

投资风险管理是基金投资管理的重要环节, 公司根据投资决策的不同层次建立完善的基金风险控制系统。

基金投资风险管理包括对投资合规性风险的管理以及对投资组合风险的管理:

1) 公司风险管理委员会定期不定期对公司投资管理制度、投资决策程序的合法性、合规性、有效性及基金运作过程中的合法性、合规性进行全面检查评价, 如发现问题, 应责成公司相关部门提出改进方案并落实。

2) 风险管理委员会和金融工程部通过审议本基金的投资运作季报, 以及对日常投资的跟踪监控, 从而控制本基金的投资组合风险。

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, 并在基金招募说明书及其更新中公告。

### (五) 标的指数



本基金股票资产的标的指数为恒生指数。

恒生指数是由香港恒生银行全资附属子公司恒生指数有限公司编制，截至2013年11月，以香港股票市场的50家上市公司股票作为成份股，以经调整的流通市值作为权数计算得到的加权平均股价指数，是目前反映香港股市走势的最具影响力的股价指数。恒生指数于1969年11月24日首次公开发布，以1964年7月31日为基期，基期指数值为100。恒生指数以港币计价。

如果指数编制单位变更或停止恒生指数的编制、发布或授权，或恒生指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致恒生数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

#### （六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{经人民币汇率调整的恒生指数收益率} \times 95\% + \text{商业银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

## （七）风险收益特征

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数及标的指数所表征的股票市场相似的风险收益特征，在股票基金中属于中等风险、中等收益的产品。

本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

此外，从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，稳健收益类的恒生 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；积极收益类的恒生 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

## （八）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金非现金资产的 80%；

（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

（4）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不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

(5) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%；

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

(6) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制；

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

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

若基金超过上述 3-8 项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；

- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (14) 买卖与其基金管理人、基金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；
- (15) 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；
- (16) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

对于因上述 13、14 项情形导致无法投资的标的指数成份股或备选成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

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

### 3、金融衍生品投资限制

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

- (1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；
- (2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；
- (3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：
  - a. 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；
  - b. 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；
  - c. 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。
- (4) 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

4、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

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

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

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

（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

a. 现金；

b. 存款证明；

c. 商业票据；

d. 政府债券；

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

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

（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

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

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

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

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

（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保

已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

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

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

### **(九) 基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法**

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

### **(十) 基金的融资融券、转融通**

本基金可以根据届时有有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

### （十一）代理投票

1、基金管理人行使代理投票权应遵循基金份额持有人利益最大化的原则。

2、行使代理投票权应考虑不同地区市场上适用的法律或监管要求、公司治理标准、披露实务操作等存在的差异，充分研究提案的合理性，并综合考虑投资顾问、独立第三方研究机构等的意见后，选择合适的方式行使投票权。本着基金投资者利益最大化的原则，对持股比例较小或审议非重要事项、支付较高费用等情况时，基金管理人可以选择不参与上市公司的投票。

3、代理投票权的执行，可选择实地投票、通过交易经纪商系统投票、委托境外投资顾问、托管人或第三方代理投票机构投票等方式。

4、基金管理人应保留投票记录。

### （十二）证券交易管理

1、基金管理人挑选证券经纪商主要考虑的因素包括：交易执行能力、研究报告质量、提供研究服务质量、法规监管资讯服务以及价值贡献等方面。

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

（2）研究报告的质量。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确等；

（3）提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

（4）法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

（5）价值贡献。主要是指证券经纪商对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

（6）其他因素。主要是证券经纪商的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

2、席位交易量的分配依据

基金管理人主要根据对证券经纪商的评价结果进行交易量分配。评价证券经纪商将重点依据其交易执行能力、研究报告质量、提供研究服务质量、法规监管资讯服务和价值贡献等方面的指标，并采用十分制进行评分。

评分的计算公式是： $\sum i(\text{第 } i \text{ 项评价项目} \times \text{项目权重})$ ，其中各项目权重由基金管理人根据相关法规要求和内部制度进行确定。

### 3、其他事项

本基金管理人将根据有关规定，在基金定期报告中对所选择的证券经纪商、基金通过该证券经纪商买卖证券的成交量以及所支付的佣金等进行披露。对于在证券经纪商选择和交易量分配中存在或潜在的利益冲突，基金管理人应该本着尽可能维护基金份额持有人的利益进行妥善处理，并按规定进行报告。

### （十三）投资组合报告

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

### 投资组合报告

#### 1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	122,190,637.84	87.71
	其中：普通股	122,190,637.84	87.71
	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	9,731,588.27	6.99
8	其他资产	7,395,069.33	5.31
9	合计	139,317,295.44	100.00

### 1.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例 （%）
香港	122,190,637.84	93.98
合计	122,190,637.84	93.98

### 1.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例 （%）
001 能源	12,309,840.13	9.47
003 工业	5,716,329.54	4.40
004 非必需消费品	6,341,475.13	4.88
005 必需消费品	4,272,692.75	3.29
007 金融	67,470,920.93	51.89
008 信息技术	11,641,629.63	8.95
009 电信服务	8,531,828.25	6.56
010 公共事业	5,905,921.48	4.54
合计	122,190,637.84	93.98

### 1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称 （英文）	公司名称 （中文）	证券 代码	所在 证券 市场	所属 国家 （地 区）	数量（股）	公允价值（人民 币元）	占基金 资产净 值比例 （%）
----	--------------	--------------	----------	----------------	----------------------	-------	----------------	--------------------------

1	HSBC Holdings plc	汇丰控股	5 HK	香港证券交易所	香港	284,400	17,743,360.50	13.65
2	Tencent Holdings Limited	腾讯	700 HK	香港证券交易所	香港	113,700	10,667,476.13	8.20
3	China Construction Bank Corporation	建设银行	939 HK	香港证券交易所	香港	1,714,000	7,972,456.75	6.13
4	AIA Group Limited	友邦保险	1299 HK	香港证券交易所	香港	245,400	7,586,924.44	5.84
5	China Mobile Limited	中国移动	941 HK	香港证券交易所	香港	123,500	7,371,715.00	5.67
6	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	香港	1,503,000	5,845,730.63	4.50
7	Bank of China Limited	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	香港	1,619,000	4,459,231.94	3.43
8	CNOOC Limited	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	香港	364,000	4,021,836.00	3.09
9	Hutchison Whampoa Limited	和记黄埔	13 HK	香港证券交易所	香港	43,000	3,617,912.50	2.78
10	PetroChina Company Limited	中国石油	857 HK	香港证券交易所	香港	430,000	3,341,449.38	2.57

**1.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**1.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

注：本基金本报告期末未持有基金。

**1.10 投资组合报告附注****1.10.1**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

**1.10.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**1.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,699,511.87
3	应收股利	1,640,525.48
4	应收利息	1,986.42
5	应收申购款	970.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	52,075.38
8	其他	-
9	合计	7,395,069.33

#### **1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### **1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

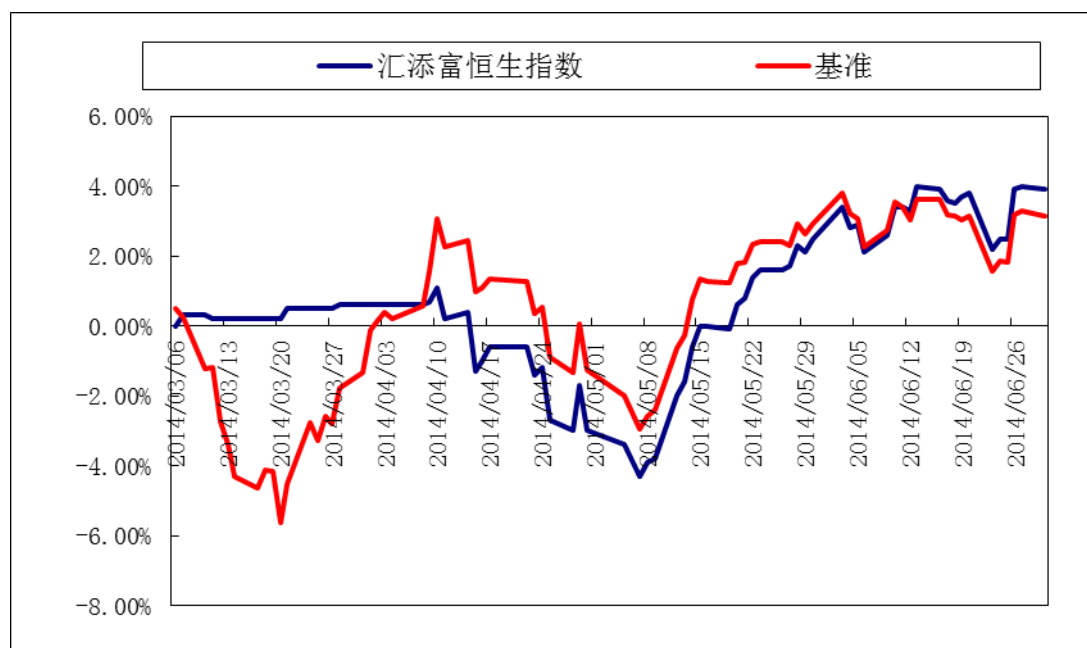
### 五、基金的业绩

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

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	净值增长率 (1)	净值增长率标准差 (2)	业绩比较基准收益率 (3)	业绩比较基准收益率标准差 (4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2014年3月6日(基金合同生效日)至2014年6月30日	3.90%	0.59%	3.14%	0.78%	0.76%	-0.19%

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



## 六、基金管理人

### （一）基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区大沽路 288 号 6 幢 538 室

办公地址：上海市富城路 99 号震旦国际大楼 22 楼

法定代表人：林利军

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]5 号

注册资本：人民币 1 亿元

联系人：李文

联系电话：（021）28932888

股东名称及其出资比例：

东方证券股份有限公司	47%
文汇新民联合报业集团	26.5%
东航金控有限责任公司	26.5%

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

潘鑫军先生，董事长。国籍：中国，1961 年出生，澳门科技大学工商管理硕士。现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长。历任中国工商银行股份有限公司上海分行长宁支行党委书记、行长兼国际机场支行党支部书记，东方证券股份有限公司党委副书记、总裁；党委书记、董事长兼总裁。

肖顺喜先生，董事。国籍：中国，1963 年出生，复旦大学 EMBA。现任东航金控有限责任公司总经理、东航集团财务有限责任公司董事长、东航国际控股（香港）有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理，东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

陈保平先生，董事。国籍：中国，1953 年出生。华东师范大学中国语言文学专业学士，南洋交大 EMBA，高级编审。现任上海市市人大代表（教科文委

员会专业委员)、市委宣传部新闻阅评督查组组长、上海市新闻工作者协会副主席,新民国际有限公司董事长、上海外滩画报传媒有限公司董事长、上海文汇新民进修学院董事长。历任文汇新民联合报业集团社长、党委副书记,新民晚报社总编辑、党委副书记,文汇新民联合报业集团副社长、文汇新民联合报业集团投资公司总经理、新民晚报社副总编辑,上海青年报社编辑、记者、部主任、副总编,上海三联书店总编辑、沪港三联副董事长,上海文艺出版总社党委书记、副社长、总编辑等。

林利军先生,董事,总经理。国籍:中国,1973年出生,美国哈佛大学商学院工商管理硕士,复旦大学世界经济系硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理,汇添富资本管理有限公司董事长、总经理。历任上海证券交易所办公室主任助理、上市部总监助理,曾任职于中国证监会创业板筹备工作组,哈佛大学毕业后就职于美国道富金融集团(State Street Global Advisor)从事投资和风险管理工作。

韦杰夫(Jeffrey R. Williams)先生,独立董事。国籍:美国,1953年出生,哈佛大学商学院工商管理硕士,哈佛大学肯尼迪政府学院资深访问学者。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长,美国运通银行台湾分行副总裁,台湾美国运通国际股份有限公司副总裁,渣打银行台湾分行总裁,深圳发展银行行长,现任哈佛上海中心董事总经理。

蔡来兴先生,独立董事,国籍:中国,1942年出生,上海同济大学学士。现任国务院参事室特约研究员,中国国学中心顾问。曾任上海市委、市政府副秘书长,香港上海实业集团董事长,香港上海实业控股有限公司董事长。第九、十、十一届全国政协委员,经济委员会委员。

杨燕青女士,独立董事,国籍:中国,1971年出生,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,中欧陆家嘴国际金融研究院特邀研究员,《第一财经日报》创刊编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》栏目创始人和主持人,《波士堂》栏目资深评论员。曾任《解放日报》主任记者,《第一财经日报》编委,2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

## 2、监事会成员

涂殷康先生,监事长。国籍:中国,1970年1月出生,上海财经大学硕士研究生。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼研发中心总经理。曾任职于中

国东方航空公司总经理办公室，历任东航期货经纪有限责任公司部门经理、副总经理，东航金控有限责任公司投资管理部经理。

任瑞良先生，监事。国籍：中国，1963 年出生，大学学历，中国注册会计师。现任文汇新民联合报业集团投资公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管，文汇新民联合报业集团投资公司财务主管、总经理助理等。

李进安先生，监事。国籍：中国，1968 年出生，金融学博士，中国注册会计师、律师资格。现任东方证券股份有限公司合规总监，上海东方证券资产管理有限公司合规总监。历任君安证券南京业务部总经理，国泰君安证券股份有限公司江苏区总协调人，国泰君安证券股份有限公司南京太平南路营业部总经理，总裁办公室、BPR 办公室常务副主任，东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁等职。

王静女士，职工监事，国籍：中国，1977 年出生，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，职工监事，国籍：中国，1977 年出生，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司稽核监察部高级经理，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，职工监事，国籍：中国，1979 年出生，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理有限公司综合办公室高级经理。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

### 3、高级管理人员

潘鑫军先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

林利军先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

李文先生，督察长。国籍：中国，1967 年出生，厦门大学管理学博士，高级经济师，中国注册会计师。历任中国人民银行厦门市分行稽核监督处科员，中国人民银行杏林支行副行长，中国人民银行厦门中心支行银行管理处处长助理、金融机构监管二处副处长，东方证券股份有限公司稽核总部总经理、资金财务管理总部总经理等。现任汇添富基金管理股份有限公司督察长，汇添富资本管理有限公司董事。



张晖先生，副总经理。国籍：中国，1971 年出生，经济学硕士，历任申银万国研究所高级分析师、富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理。2005 年 4 月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理、投资决策委员会副主席。

陈灿辉先生，副总经理。国籍：中国，1967 年出生，大学本科，历任中国银行软件开发工程师，招银电脑有限公司证券基金事业部负责人，华夏基金管理有限公司资深高级经理，招商基金管理有限公司信息技术部总监、总经理助理。2008 年 7 月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理、首席营运官。

雷继明先生，副总经理。国籍：中国，1971 年出生，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011 年 12 月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，国籍：中国，1971 年出生，，英国格拉斯哥大学金融经济学硕士，近 20 年证券从业经验。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

#### 4、基金经理

赖中立先生，国籍：中国，北京大学中国经济研究中心金融学硕士，7 年证券从业经验。曾任泰达宏利基金管理有限公司风险管理分析师。2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司任金融工程部分析师。2012 年 2 月 15 日至今任汇添富上证综合指数基金、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理，2012 年 11 月 1 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理，2014 年 3 月 6 日至今任汇添富恒生指数分级（QDII）基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会

主席：林利军先生（总经理）

副主席：张晖先生（副总经理）

成员：韩贤旺先生（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

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

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记结算事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；

（6）与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；

（7）进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

（8）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（10）依法接受基金托管人的监督；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（14）计算并公告基金资产净值、添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值、基金份额折算比例和添富恒生份额的申购、赎回

价格；

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

(16) 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；

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

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

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

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

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

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

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

(25) 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；

(26) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集有效认购款项、股票连同有效认购款项的银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- (27) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (28) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (29) 法律法规及中国证监会、外管局规定的和基金合同约定的其他义务。

#### **(四) 基金管理人和基金经理的承诺**

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

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

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；

- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的风险管理体系

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

##### 1、风险管理原则

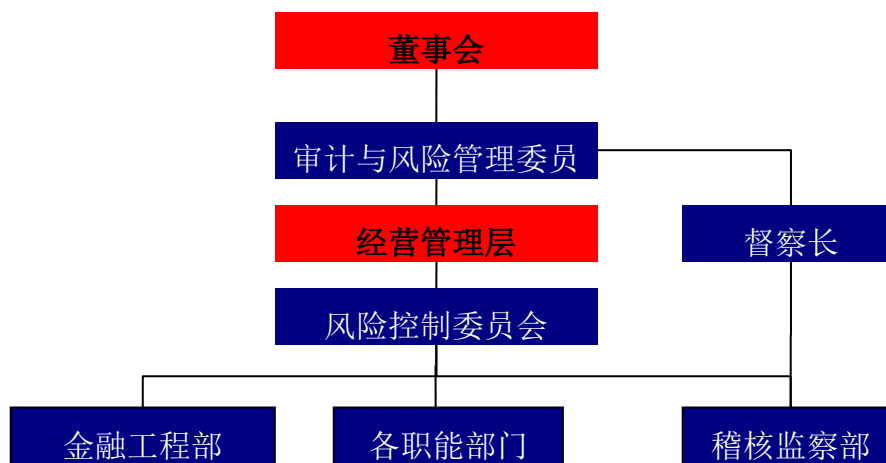
基金管理人风险管理体系的构建遵循以下六项基本原则：

- (1) 营造良好的风险管理文化和内部控制环境，使风险意识贯穿到每位员工、各个岗位和经营管理的各个环节。
- (2) 建立完善的风险管理组织体系，切实保证风险管理部门的独立性和权威性，使其有效地发挥职能作用。
- (3) 确保风险管理制度的严肃性，保证风险管理制度在投资管理和经营活动过程中得到切实有效的执行。
- (4) 运用合理有效的风险指标和模型，实现风险事前配置和预警、事中实时监控、事后评估和反馈的全程嵌入式投资风险管理模式。
- (5) 建立和推进员工职业守则教育和专业培训体系，确保员工具备良好的职业操守和充分的职责胜任能力。
- (6) 建立风险事件学习机制，认真剖析各类风险事件，汲取经验和教训，不断完善风险管理体系。

## 2、风险管理组织架构

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

汇添富风险管理组织结构图



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

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

（3）金融工程部、稽核监察部是风险管理的职能部门。金融工程部负责投资组合市场风险、信用风险、流动性风险等的管理。稽核监察部负责合规风险、营运风险、道德风险等的管理。

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

## 3、风险管理内容

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

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

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

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

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

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

#### **(六) 基金管理人的内部控制制度**

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

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

##### **1、内部控制目标**

(1) 保证基金管理人经营运作遵守国家法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金管理人和基金财务及其他信息的真实、准确、及时、完整。

##### **2、内部控制原则**

(1) 健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金资产、固有财产、其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

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

### 3、内部控制内容

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

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

#### (1) 投资管理业务控制

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

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

#### (2) 信息披露控制

基金管理人通过完善信息披露制度，确保基金份额持有人及时完整地了解基金信息。基金管理人按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立了《汇添富基



基金管理股份有限公司信息披露管理制度》，指定了信息披露责任人负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布，并将定期对信息披露进行检查和评价，保证公开披露的信息真实、准确、完整。

### （3）信息技术系统控制

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

### （4）会计系统控制

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

### （5）内部稽核控制

基金管理人通过建立独立的监察稽核制度，确保内部控制的有效性。基金管理人设立督察长，督察长可以列席基金管理人召开的任何会议，调阅相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

另外，在经营管理层设立稽核监察部门，配备充足合格的稽核监察人员，并制订了《汇添富基金管理股份有限公司稽核监察制度》，明确规定了稽核监察部门及内部各岗位的职责和工作流程，监督各业务部门和人员遵守法律、法规和规

章的有关情况；检查各业务部门和人员执行内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

#### 4、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部控制制度。

## 七、基金份额的分类和净值计算规则

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括汇添富恒生指数分级证券投资基金之基础份额（简称“添富恒生份额”）、汇添富恒生指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“恒生A份额”）与汇添富恒生指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“恒生B份额”）。其中，恒生A、恒生B的基金份额配比始终保持1：1的比率不变。

### （二）基金的基本运作概要

1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，全部基金份额将确认为添富恒生份额；

2、投资者场内认购的全部添富恒生份额将按1：1的比例自动分离成预期收益与预期风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的恒生A份额和积极收益类的恒生B份额，两类基金份额的基金资产合并运作。

3、投资者在场内申购的添富恒生份额可按1：1的比例申请分拆为恒生A份额和恒生B份额，分别上市交易。

4、投资者在场外认购和申购的添富恒生份额不进行分拆，其通过跨系统转托管至场内后，可选择将其持有的添富恒生份额按1：1的比例分拆为恒生A份额和恒生B份额。

5、基金发售结束后，添富恒生份额可接受申购和赎回；恒生A份额、恒生B份额只上市交易，不接受申购和赎回。

6、基金发售结束后，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理添富恒生份额与恒生A份额、恒生B份额之间的份额配对转换业务。

7、定期折算机制：除了基金合同生效日的所在会计年度外，恒生A份额的份额参考净值超过1.000元部分折算成添富恒生份额。

8、不定期折算机制：除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：（1）当添富恒生份额的基金份额净值达到1.500元；（2）当恒生B份额的基金份额参考净值等于或小于0.250元。

### （三）恒生 A 份额、恒生 B 份额概要

#### 1、存续期限

自基金合同生效日起存续。经基金份额持有人大会决议通过，恒生 A 份额与恒生 B 份额可申请终止运作。恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作后，恒生 A 份额与恒生 B 份额将全部转换为添富恒生份额的场内份额。

#### 2、基金份额配比

恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额配比始终保持 1：1 的比例不变。

#### 3、恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额参考净值计算规则

根据恒生A份额和恒生B份额的风险和收益特性不同，本基金份额所分离的两类基金份额恒生A份额和恒生B份额具有不同的净值计算规则。

在本基金的存续期内，本基金将在每个工作日按基金合同约定的净值计算规则对恒生A份额和恒生B份额分别进行净值计算，恒生A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；恒生B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额，本基金两级子份额净资产在优先确保恒生A份额的本金及累计约定应得收益后，将剩余净资产计为恒生B份额的净资产。

在本基金存续期内，恒生A份额和恒生B份额的净值计算规则如下：

（1）恒生A份额约定年基准收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率（税后）+3.00%”，同期银行人民币一年期定期存款利率以当年1月1日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。基金合同生效日所在年度的年基准收益率为“基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率（税后）+3.00%”。年基准收益均以1.00元为基准进行计算；

（2）本基金每个工作日对恒生A份额和恒生B份额进行净值计算。在进行恒生A份额和恒生B份额各自的净值计算时，本基金两级子份额净资产优先确保恒生A份额的本金及恒生A份额累计约定应得收益，之后的剩余净资产计为恒生B份额的净资产。恒生A份额累计约定应得收益按依据恒生A份额约定年基准收益率计算的每日收益率和截至计算日恒生A份额应计收益的天数确定；

（3）每2份添富恒生份额所代表的资产净值等于1份恒生A份额和1份恒生B份额的资产净值之和；

(4) 在本基金的基金合同生效日所在会计年度或存续的某一完整会计年度内，若未发生基金合同规定的不定期份额折算，则恒生A份额在净值计算日应计收益的天数按自基金合同生效日至计算日或上一次定期折算日至计算日的实际天数计算；若发生基金合同规定的不定期份额折算，则恒生A份额在净值计算日应计收益的天数应按照最近一次该会计年度内不定期份额折算日至计算日的实际天数计算。

基金管理人并不承诺或保证恒生A份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，恒生A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

#### (四) 本基金基金份额净值/参考净值的计算步骤

本基金作为分级基金，按照恒生A份额和恒生B份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告T日添富恒生份额、恒生A份额和恒生B份额的基金份额净值/参考净值：

##### 1、添富恒生份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T日添富恒生份额的基金份额净值 = T日闭市后的基金资产净值 / T日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T日本基金基金份额的总数为恒生A份额、恒生B份额和添富恒生份额的份额数之和。

##### 2、恒生A份额和恒生B份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_{\text{恒生A}} = (1 + R)^{\frac{t}{N}}$$

$$NAV_{\text{恒生B}} = (2 \times NAV_{\text{添富恒生}} - NAV_{\text{恒生A}})$$

设T日为基金份额净值计算日， $T=1, 2, 3, \dots, N$ ； $N$ 为当年实际天数； $t = \min\{\text{自基金合同生效日至T日}, \text{自最近一次份额折算日至T日}\}$ ；

$NAV_{\text{添富恒生}}$ 为T日每份添富恒生份额的基金份额净值； $NAV_{\text{恒生A}}$ 为T日恒生A份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{恒生B}}$ 为T日恒生B份额的基金份额参考净值； $R$ 为恒生A份额约定年基准收益率。

添富恒生份额、恒生A份额和恒生B份额的基金份额净值/参考净值的计算，均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。特别的，在基金运作的折算基准日，添富恒生份额和恒生B份额的基金份额参考净值的计算结果保留到小数点后8位，小数点后第9位四舍五入。

T日的恒生A份额和恒生B份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在T+1日与添富恒生份额的基金份额净值一同公告。公告的基金份额净值/参考净值均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 八、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《试行办法》、《通知》等有关法律法规以及基金合同的规定，经 2013 年 9 月 25 日中国证监会证监许可【2013】1247 号文件核准募集。

### （一）基金的类型及存续期间

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

### （二）募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

### （三）募集规模

本基金可根据中国证监会、外管局核准的境外投资额度设定基金募集规模上限。

基金合同生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据境外证券投资额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

### （四）募集方式

本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

场内发售是指通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位发售基金份额的行为（具体名单见本基金基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得基金销售资格，但属于深交所会员的其他机构，可在恒生 A 份额、恒生 B 份额上市后，代理投资人通过深交所交易系统参与恒生 A 份额、恒生 B 份额的上市交易。

场外发售是指通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及场外代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告）场外公开发售基金份额的行为。

通过场内认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统持有人深圳证券账户下；通过场外认购的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司注册登记系统基金份额持有人的开放式基金账户下。

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

### **（五）募集对象**

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者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人。

### **（六）募集场所**

#### **1、场外募集场所**

场外募集通过本基金的直销机构与代销机构进行，代销机构的具体名单详见基金份额发售公告。

#### **2、场内募集场所**

场内募集在具有基金销售资格的深圳交易所会员单位进行，具体名单详见基金份额发售公告。

上述销售机构办理本基金销售的具体情况和联系方法，请参见本基金之基金份额发售公告。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告

### **（七）基金份额初始面值**

本基金添富恒生份额的初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。

### **（八）认购费用**

本基金的认购费率按认购金额进行分档。投资人在一天之内如果有多笔认



购，适用费率按单笔分别计算。本基金认购费率如下：

费用种类	认购金额（M，含认购费）	认购费率
场外认购费	$M < 100$ 万	1.0%
	$100 \text{ 万} \leq M < 300$ 万	0.6%
	$300 \text{ 万} \leq M < 500$ 万	0.3%
	$500 \text{ 万} \leq M < 1000$ 万	0.10%
	$1000 \text{ 万} \leq M$	按笔收取，每笔 1,000 元
场内认购费	深圳证券交易所会员单位应参照场外认购费率设定投资者的场内认购费率。	

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用，不从基金财产中列支。

### （九）场内认购金额和利息折算份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为：

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额

认购费用 = 挂牌价格 × 认购份额 × 认购费率，或认购费用 = 固定认购费金额

认购金额 = 净认购金额 + 认购费用

利息折算的份额 = 利息 / 挂牌价格

认购金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入。利息折算份额的计算截位保留到整数位，剩余部分计入基金财产。

举例：某投资人选择通过场内认购本基金 100,000 份基金份额，认购费率为 1.0%，假定募集期产生的利息为 50.50 元，则可认购基金份额为：

认购金额 =  $1.00 \times 100,000 \times (1 + 1.0\%) = 101,000$  元

认购费用 =  $1.00 \times 100,000 \times 1.0\% = 1,000$  元

净认购金额 =  $1.00 \times 100,000 = 100,000$  元

利息折算的份额 =  $50.50 / 1.00 = 50$  份

即：投资人认购 100,000 份基金份额，需缴纳认购金额 101,000 元，若募集期产生的利息为 50.50 元，利息折算的份额截位保留到整数位为 50 份，其余 0.50 份对应金额计入基金财产，最后该投资人实得认购份额为 100,050 份。

### （十）场外认购份额的计算

本基金场外采用金额认购方式认购，基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。

本基金场外认购份额的计算包括认购金额和认购金额在募集期内产生的利息（具体数额以本基金登记机构计算并确认的结果为准）折算的基金份额。场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

净认购份额和认购费用的计算方法：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)，或净认购金额 = 认购金额 - 固定认购费金额

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额，或认购费用 = 固定认购费金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额初始面值

举例：某投资者投资 100 万元认购添富恒生份额，假设该笔认购产生利息 500 元，则其可得到的认购份额为：

净认购金额 =  $1,000,000 / (1 + 0.6\%) = 994,035.79$  元

认购费用 =  $1,000,000 - 994,035.79 = 5964.21$  元

认购份额 =  $(994,035.79 + 500) / 1.00 = 994,535.79$  份

### （十一）投资人对基金份额的认购

#### 1、认购的时间和程序

认购时间安排、投资人认购时应提交的文件和办理的手续、认购的方式及确认等均在基金份额发售公告中详细列明，请参见基金份额发售公告及销售机构的相关公告。

#### 2、认购的限制

（1）本基金场内认购采用份额认购的方式，场外认购采用金额认购方式。

（2）投资者认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

(3) 投资者在认购期内可以多次认购基金份额，已确认的申请不允许撤消。

(4) 通过场内代销机构认购本基金时，单笔最低认购份额为 50,000 份，超过 50,000 份的必须是 1,000 份的整数倍，且单笔认购最高不超过 99,999,000 份。

(5) 投资者通过场外代销机构认购，单个基金帐户单笔最低认购金额为 1,000 元（含认购费），追加认购的单笔认购最低金额为人民币 1,000 元（含认购费）。本公司直销中心首次认购的最低金额为人民币 50,000 元（含认购费），网上直销系统（trade.99fund.com）认购最低金额为人民币 1,000 元（含认购费），超过最低认购金额的部分不设金额级差。各代销机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

(6) 基金募集期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

(7) 投资者在 T 日规定时间内提交的认购申请，通常应在 T+2 日后及时到原认购网点查询认购申请的确认情况。但此次确认是对认购申请的确认，认购的最终结果要待基金合同生效后才能够确认。

(8) 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接受了认购申请，申请的成功与否应以基金登记机构的确认结果为准。

(9) 如果法律法规对单笔认购限制进行变更的，以变更后的规定为准。

## （十二）募集期间认购资金利息的处理方式

投资者的有效认购款项在募集期内所产生的利息（以本基金的登记机构计算并确认的结果为准），在基金合同生效后折算成基金份额，归基金份额持有人所有。

本基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## （十三）恒生 A 份额和恒生 B 份额的计算

投资者经场内认购的添富恒生份额在基金发售结束后，全部份额将按 1:1 的比例自动分离，确认为恒生 A 份额与恒生 B 份额。投资者经场外认购的添富恒生份额既可在基金管理人开始办理添富恒生份额的赎回业务之后，直接申请场外赎回；也可在跨系统转托管业务开通后，转托管至证券登记结算系统，在基金管理人开始办理添富恒生份额的赎回业务后申请场内赎回；或在基金管理人开通份

额配对转换业务后，经基金份额持有人进行申请，按 1: 1 的比例分离为恒生 A 份额与恒生 B 份额。

场内认购自动分离的恒生 A 份额与恒生 B 份额，以及场外认购并通过跨系统转托管至场内、且经基金份额持有人申请分拆后的恒生 A 份额与恒生 B 份额自上市之日起可在深圳证券交易所上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

#### **(十四) 基金募集情况**

本基金募集期为 2014 年 1 月 24 日至 2014 年 2 月 28 日。经会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集 1,270,631,138.98 份基金份额（其中包括利息转份额 514,704.33 份），其中，场外认购的基金份额确认为 1,051,208,262.98 份，场内认购的基金份额确认为 219,422,876.00 份。有效认购户数为 13,515 户。其中，汇添富基金管理股份有限公司基金从业人员认购本基金基金份额 3,962.69 份（含募集期利息结转的份额），占基金总份额比例 0.0003%。

## 九、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足募集生效条件,基金管理人应当承担下列责任:

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

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金规模

《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

### （四）本基金基金合同于2014年3月6日正式生效。

## 十、恒生 A 份额与恒生 B 份额的上市与交易

### （一）上市交易的基金份额

本基金分级运作期内，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，恒生 A 份额与恒生 B 份额将在深圳证券交易所上市与交易；登记在注册登记系统中的添富恒生份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统并成功分拆为恒生 A 份额和恒生 B 份额后，恒生 A 份额和恒生 B 份额方可上市交易。

本基金分级运作终止后，恒生 A 份额与恒生 B 份额将终止在深圳证券交易所上市，并分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）基金份额，转换后的上市开放式基金（LOF）份额在深圳证券交易所上市与交易。场内的添富恒生份额直接转换为上市开放式基金（LOF）份额，并在深圳证券交易所上市交易；场外的添富恒生份额跨系统转托管至场内后，方可在深圳证券交易所上市交易。

### （二）上市交易的地点

本基金上市交易地点为深圳证券交易所。

### （三）上市交易的时间

分级运作期起始后三个月内，恒生 A 份额和恒生 B 份额开始在深圳证券交易所上市交易。

分级运作终止转换为上市开放式基金（LOF）后三个月内，上市开放式基金（LOF）基金份额开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登《上市交易公告书》。

本基金之恒生 A、恒生 B 基金份额已于 2014 年 4 月 11 日开始在深圳证券交易所上市交易。

### （四）上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

- 1.本基金分级运作期内，恒生 A 份额与恒生 B 份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的参考净值；
- 2.本基金分级运作终止转换为上市开放式基金（LOF）基金份额后，上市开放式基金（LOF）基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值；
- 3.本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 4.本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 5.本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 6.本基金上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及相关规定。

#### （五）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

#### （六）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额参考净值。

#### （七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 十一、添富恒生基金份额的申购与赎回

基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对添富恒生份额进行申购与赎回。恒生 A 份额、恒生 B 份额只上市交易，不接受申购与赎回。

### （一）申购与赎回场所

添富恒生份额的申购与赎回将通过销售机构进行，包括场外和场内两种方式。

添富恒生份额的场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点；场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位。具体的销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购与赎回的开放日及开放时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理添富恒生份额的申购和赎回，具体办理时间为深圳证券交易所和香港联合交易所的正常交易日的交易时间。如遇国内的节假日则顺延至下一开放日。当境外主要市场节假日休市时，基金管理人可以暂停申购或赎回。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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



基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理添富恒生基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其添富恒生基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

本基金的添富恒生份额已于 2014 年 4 月 8 日起开始办理日常申购、赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即添富恒生份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的添富恒生基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外基金份额持有人在赎回基金份额时，遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理添富恒生份额的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所和登记结算机构的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或登记结算机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

6、若将来条件许可，本基金可以接受投资者以人民币以外的其他货币申购、赎回，并经与基金托管人协商一致后相应修改基金合同的必要部分，而无需召开基金份额持有人大会；

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

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

## 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购添富恒生份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。投资人在提交赎回申请时须持有足够的添富恒生份额余额，否则所提交的赎回申请无效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+10 日(包括该日)内支付赎回款项，但中国证监会另有规定除外。外管局相关规定有变更或本基金所投资市场的交易清算规则有变更时，赎回款支付时间将相应调整。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

## 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

### (五) 申购和赎回的数额限制

#### 1、基金申购的限制

场外申购时，投资者通过代销网点单笔申购添富恒生份额的最低金额(含申购费)为 1,000 元；通过本基金管理人直销中心申购，单笔最低申购金额为 5 万元人民币(含申购费)。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

场内申购时，单笔申购金额最低为 50,000 元。

基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素对基金的最低申购、赎回单位进行调整并提前公告。

基金管理人可根据境外证券投资额度、基金组合情况等因素，设定申购份额上限和赎回份额上限，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制。

#### 2、基金赎回的限制

每次赎回添富恒生份额不得低于 100 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构网点保留的添富恒生份额余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。实际操作中，以各代销机构的具体规定为准。

通过本基金管理人电子自助交易系统赎回，每次赎回份额不得低于 100 份。

如遇巨额赎回等情况发生而导致延期赎回时，赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整对添富恒生份额的申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人在调整前必须依据《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

4、如果法律法规对单笔申购限制进行变更的，以变更后的规定为准。

### （六）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，场外申购份额的计算结果均按照四舍五入方法，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。场内申购份额的计算采用截位法保留至整数位，不足 1 份额对应的申购资金返还至投资者资金账户。

添富恒生份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/（1+申购费率），或净申购金额=申购金额-固定申购费金额

申购费用 =申购金额-净申购金额，或申购费用=固定申购费金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

举例：某投资人投资 10 万元通过场外申购添富恒生份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用=100,000×1.2%/（1+1.2%）=1,185.77 元

净申购金额=100,000-1,185.77=98,814.23 元

申购份额=98,814.23/1.015=97,353.92 份

即投资人投资 10 万元通过场外申购添富恒生份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 97,353.92 份添富恒生份额。

举例：某投资人投资 10 万元通过场内申购添富恒生份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用=100,000×1.2%/（1+1.2%）=1,185.77 元

$$\text{净申购金额} = 100,000 - 1,185.77 = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.015 = 97,353 \text{ 份（保留至整数位）}$$

$$\text{实际净申购金额} = 97,353 \times 1.015 = 98,813.30 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,813.30 - 1,185.77 = 0.93 \text{ 元}$$

即投资人投资 10 万元通过场内申购添富恒生份额，假设申购当日基金份额净值为 1.015 元，则可得到 97,353 份添富恒生份额，申购费用为 1,185.77 元。

2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，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。

添富恒生份额的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

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

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

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

举例：某投资人持有 10 万份添富恒生份额，持有一年六个月后在场外赎回，赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.015 = 101,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 101,500 \times 0.25\% = 253.75 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 101,500 - 253.75 = 101,246.25 \text{ 元}$$

即投资人持有 10 万份添富恒生份额，持有一年六个月后在场外赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 101,246.25 元。

举例：某投资人持有 10 万份添富恒生份额，持有一年六个月后在场内赎回，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 100,000 \times 1.015 = 101,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 101,500 \times 0.5\% = 507.5 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 101,500 - 507.5 = 100,992.50 \text{ 元}$$

即投资人持有 10 万份添富恒生份额，持有一年六个月后在场内赎回，假设

赎回当日基金份额净值是 1.015 元，则其可得到的赎回金额为 100,992.50 元。

### （七）申购和赎回的费用及其用途

#### 1、添富恒生份额的申购费用

本基金添富恒生份额申购采用金额申购方式，场外申购费率如下表。投资者在一天之内如果有多笔申购，费率按单笔分别计算。

申购金额 M（含申购费）	申购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M<300 万	0.8%
300 万≤M<500 万	0.4%
500 万≤M<1000 万	0.20%
1000 万≤M	按笔收取，1000 元/笔

本基金添富恒生份额的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

添富恒生份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

#### 2、赎回费用

添富恒生份额的场外赎回费率不高于 0.5%，随基金份额持有期限的增加而递减；添富恒生份额的场内赎回费率为固定赎回费率 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。从场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管日转入确认日开始计算。

连续持有时间（N）	场外赎回费率
N<1 年	0.5%
1 年≤N<2 年	0.2%
2 年≤N	0%

（注：1 年指 365 天，2 年为 730 天，以此类推）

3、添富恒生份额的申购费用由申购人承担，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

添富恒生份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 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。

4、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调低添富恒生份额的申购费率和赎回费率。并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### **（八）促销期间可调低申赎费率**

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以适当调低添富恒生份额的申购费率和基金赎回费率。

#### **（九）拒绝或暂停申购的情形**

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、基金投资的主要市场正常或非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金投资所处的主要市场或外汇市场休市时。
- 5、本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时。
- 6、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
- 7、基金资产规模或者份额数量达到了基金管理人规定的上限（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）。
- 8、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 9、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1-7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、本基金投资的主要市场正常或非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金投资所处的主要市场或外汇市场休市时。
- 5、本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时。
- 6、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
- 7、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 7 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请场外赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。

## （十一）巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若添富恒生单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额（包括添富恒生份额、恒生 A 份额和恒生 B 份额）的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的场外赎回申请的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定场外赎回申请的全额赎回或部分延期赎回。

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所相应规则进行处理；基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

### 3、巨额赎回的公告



当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者基金管理人网站在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

#### **（十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

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

#### **（十三）基金转换**

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

#### **（十四）基金的非交易过户**

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

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

### （十五）定期定额投资计划

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

本基金的添富恒生份额已于2014年4月8日起开始办理定期定额投资业务。

### （十六）基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

### （十七）多币种的申购、赎回

基金管理人可以在相关法律法规允许、相应技术条件成熟的情况下，开通多币种（包括但不限于美元、港币）的申购、赎回业务，不同币种的申购、赎回价格以受理申请当日的对应币种折算净值为基准计算。多币种的申购、赎回业务细则以基金管理人的相关公告为准。

## 十二、基金的认购、申购和赎回等业务的代理

本基金的认购、申购、赎回等业务可由基金管理人及基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回等业务的，应与其签订书面委托代理协议，以明确双方的权利和义务。

基金管理人和代销机构应严格按照法律法规和《基金合同》的规定办理本基金的认购、申购和赎回等业务。

## 十三、基金份额的系统内转托管、跨系统登记等其他业务

### （一）基金份额的登记

1、本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的添富恒生份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；恒生 A 份额、恒生 B 份额，以及场内申购买入的添富恒生份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的添富恒生份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的添富恒生份额可申请场外赎回。

3、登记在证券登记结算系统中的恒生 A 份额、恒生 B 份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。

### （二）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理添富恒生份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有添富恒生份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理恒生 A 份额、恒生 B 份额上市交易或添富恒生份额场内赎回业务的会员单位（席位）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

### （三）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的添富恒生份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、添富恒生份额跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

本基金已于 2014 年 4 月 2 日起开通汇添富恒生指数分级基金跨系统转托管业务。

（四）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，并按照规定进行公告。

## 十四、基金份额的配对转换

(一) 份额配对转换是指本基金的添富恒生份额与恒生 A 份额、恒生 B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

### 1、分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每两份添富恒生份额的场内份额申请转换成一份恒生 A 份额与一份恒生 B 份额的行为。

### 2、合并

合并指基金份额持有人将其持有的每一份恒生 A 份额与一份恒生 B 份额申请转换成两份添富恒生份额的场内份额的行为。

## (二) 份额配对转换的原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请分拆为恒生 A 份额和恒生 B 份额的添富恒生份额的场内份额必须是偶数。

3、申请合并为添富恒生份额的恒生 A 份额与恒生 B 份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4、添富恒生份额的场外份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为添富恒生份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则；

基金管理人、基金登记结算机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在至少一家指定媒体公告。

### 6、暂停场内份额配对转换的情形

(1) 深圳证券交易所、基金登记结算机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

(2) 法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业

务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

### **（三）份额配对转换的业务办理机构和办理时间**

投资者应当在已开通份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。自本基金开通份额配对转换业务之日起，依据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司有关规定获得业务办理资格的其他深圳证券交易所会员单位也可办理本基金的份额配对转换业务，可在深圳证券交易所网站查询。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），业务办理时间为上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00。在此时间之外不办理份额配对转换业务。若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

添富恒生、恒生 A、恒生 B 之间的份额配对转换业务已于 2014 年 4 月 11 日开通。

### **（四）份额配对转换的业务办理费用**

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人签订的主次托管协议为本基金在境外开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

境外托管人根据基金财产所在地法律法规、证券交易所规则、市场惯例及其与基金托管签订的主次托管协议持有并保管基金财产。基金托管人在已根据《试



行办法》的要求谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，且境外托管人已按照当地法律法规、本合同及托管协议的要求保管托管资产的前提下，基金托管人对境外托管人破产产生的损失不承担责任。但基金托管人根据基金管理人的指令采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。除非基金管理人、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，基金管理人、基金托管人不对境外托管人依据当地法律法规、证券交易所规则、市场惯例的作为或不作为承担责任。

## 十六、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

基金所拥有的所有金融资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠

计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、因持有股票而享有的配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若配股权证可以在交易所交易，则按照 1 中确定的方法进行估值；不能在交易所交易的配股权证，如果收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，如果收盘价低于或等于配股价，则估值为零。

4、对于非上市证券，采用公允价值进行估值，具体可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；若价格无法通过公开信息取得，参照最近一个交易日可取得的主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

5、开放式基金的估值以其在估值日公布的净值进行估值，开放式基金未公布估值日的净值的，以估值日前最新的净值进行估值。若基金价格无法通过公开信息取得，参照最近一个交易日可取得的主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，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。

7、外汇汇率

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

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

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

## 8、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的会计处理。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外资产托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。

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

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

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

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

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

## （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规

或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任

方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；  
2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；  
3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### （七）基金净值的确认

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

### （八）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（三）款有关估值方法规定的第 10 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、指数编制机构及登记机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

如果恒生 A 份额与恒生 B 份额未终止运作，本基金存续期内（包括添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额）不进行收益分配。如果恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作，本基金将根据基金合同的规定转为上市开放式基金（LOF），届时本基金将调整基金的收益分配，并遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，场外投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。场内基金份额收益分配方式只能为现金分红；场内基金份额具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及登记机构的相关规定；

3、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案



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

#### **（五）收益分配方案的确定、公告与实施**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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

#### **（六）基金收益分配中发生的费用**

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

## 十八、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的信息披露费用。
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金收益分配中发生的费用。
- 9、基金进行外汇兑换交易的相关费用。
- 10、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等。
- 11、其他为基金的利益而产生的费用，如代表基金投票产生的费用、与基金有关的诉讼费、追索费等。
- 12、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”）；
- 13、基金上市费用及年费；
- 14、标的指数的许可使用费；
- 15、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需要根据与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数使用费。指数使用费自基金首次挂牌之日起累计，计算方法如下：

$$H = E \times 0.04\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

若一个会计年度累计计提指数使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于年末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。

指数使用费每日计提，按季支付。经基金管理人和基金托管人核对一致后，基金托管人于次季度首日起 15 日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述“一、基金费用的种类中第 3—15 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十九、基金份额的折算规则

### （一）定期份额折算

在添富恒生份额、恒生 A 份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）1 月份的第一个工作日进行折算，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

#### 1、基金份额折算基准日

每个会计年度的 1 月份的第一个工作日，基金合同生效日所在的第一个会计年度不折算。

#### 2、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的添富恒生份额、恒生 A 份额。

#### 3、基金份额折算频率

每年折算一次。

#### 4、基金份额折算方式

恒生 A 份额和恒生 B 份额按照本招募说明书上述“七、基金份额的分类和净值计算规则”进行净值计算，对恒生 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份添富恒生份额将按 1 份恒生 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，恒生 A 份额和恒生 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

折算前的恒生 A 份额持有人，以恒生 A 份额在基金份额折算基准日的基金份额参考净值超出本金 1.000 元部分，获得新增添富恒生份额的份额分配。折算不改变恒生 A 份额持有人的资产净值，其持有的恒生 A 份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内添富恒生份额。

折算前的添富恒生份额的基金份额持有人，以每 2 份添富恒生份额，按 1 份恒生 A 份额的份额分配，获得新增添富恒生份额。持有场外添富恒生份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外添富恒生份额的分配；持有场内添富恒生份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内添富恒生份额的分配。折算不改变添富恒生份额持有人的资产净值。

经过上述份额折算，恒生 A 份额和添富恒生份额的基金份额参考净值将相应调整。

每个会计年度 1 月份的第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对恒生 A 份额和添富恒生份额进行应得收益的定期份额折算，有关计算公式如下：

(1) 恒生 A 份额

$$NUM_{恒生A}^{后} = NUM_{恒生A}^{前}$$

定期份额折算后恒生 A 份额的份额数 = 定期份额折算前恒生 A 份额的份额数

定期份额折算后添富恒生份额的份额净值为：

$$NAV_{添富恒生}^{后} = \frac{NAV_{添富恒生}^{前} \times NUM_{添富恒生}^{前} - \frac{1}{2} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000) \times NUM_{添富恒生}^{前}}{NUM_{添富恒生}^{前}}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$= \frac{NUM_{恒生A}^{前} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000)}{NAV_{添富恒生}^{后}}$$

其中：

$NUM_{恒生A}^{前}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额数

$NUM_{恒生A}^{后}$ ：定期份额折算后恒生 A 份额的份额数

$NAV_{添富恒生}^{前}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额净值

$NAV_{添富恒生}^{后}$ ：定期份额折算后添富恒生份额的份额净值

$NAV_{恒生A}^{前}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额参考净值

$NUM_{添富恒生}^{前}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额数

(2) 恒生 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变恒生 B 份额的参考净值及其份额数。

(3) 添富恒生份额

$$NAV_{添富恒生}^{后} = \frac{NAV_{添富恒生}^{前} \times NUM_{添富恒生}^{前} - \frac{1}{2} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000) \times NUM_{添富恒生}^{前}}{NUM_{添富恒生}^{前}}$$

定期份额折算后添富恒生份额持有人新增的添富恒生份额的份额数

$$= \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后添富恒生份额的份额数 = 定期份额折算前添富恒生份额的份额数 + 添富恒生份额持有人新增的添富恒生份额的份额数

即：

$$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}} = \text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} + \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}}$$

其中：

$\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后添富恒生份额净值

$\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前恒生 A 份额的份额参考净值

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：定期份额折算前添富恒生份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：定期份额折算后添富恒生份额的份额数

## 5. 举例：

假设在本基金成立后第 2 个分级运作周年的第一个工作日（定期份额折算基准日），添富恒生份额（场外与场内合计）当天折算前资产净值为 8,050,000,000 元。当天场外添富恒生份额、场内添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的份额数分别为 50 亿份、20 亿份、30 亿份、30 亿份。定期份额折算前添富恒生份额净值为 1.070 元；定期份额折算当日未发生不定期份额折算。

### （1）恒生 A 份额

定期份额折算后添富恒生份额的份额净值为：

$$\begin{aligned} \text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}} &= \frac{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} \times \text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} - \frac{1}{2} \times (\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000) \times \text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}} \\ &= \text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} - \frac{1}{2} \times (\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000) \\ &= \frac{8,050,000,000}{5,000,000,000 + 2,000,000,000} - \frac{1.070 - 1.000}{2} \\ &= 1.115 \text{ (元)} \end{aligned}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= \frac{\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000)}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}} \\
&= \frac{3,000,000,000 \times (1.070 - 1.000)}{1.115} \\
&= 188,340,807(\text{份})
\end{aligned}$$

恒生 A 份额新增份额折算成添富恒生份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。因此，恒生 A 份额持有人新增场内添富恒生份额合计为 188,340,807 份；折算完后恒生 A 份额仍为 30 亿份。

### （2）恒生 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变恒生 B 份额的参考净值及其份额数，即恒生 B 份额仍为 30 亿份。

### （3）添富恒生份额

定期份额折算后场外添富恒生份额持有人新增的场外添富恒生份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}} \\
&= \frac{5,000,000,000.00}{2} \times \frac{1.070 - 1.000}{1.115} \\
&= 156,950,675(\text{份})
\end{aligned}$$

定期份额折算后场外添富恒生份额的份额数

= 定期份额折算前场外添富恒生份额的份额数 + 场外添富恒生份额持有人新增的场外添富恒生份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= 5,000,000,000.00 + 156,950,675 \\
&= 5,156,950,675(\text{份})
\end{aligned}$$

定期份额折算后场内添富恒生份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - 1.000}{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}} \\
&= \frac{2,000,000,000.00}{2} \times \frac{1.070 - 1.000}{1.115} \\
&= 62,780,270(\text{份})
\end{aligned}$$



$$\begin{aligned} & \text{定期份额折算后场内添富恒生份额的份额数} \\ &= \text{定期份额折算前场内添富恒生份额的份额数} + \text{场内添富恒生份额持有人} \\ & \text{新增的场内添富恒生份额的份额数} \\ &= 2,000,000,000.00 + 62,780,270 \\ &= 2,062,780,270 \text{ (份)} \end{aligned}$$

在实施定期份额折算时，恒生 A 份额及添富恒生份额折算的具体计算过程及计算结果以基金管理人届时发布的折算结果公告为准。

#### 6、基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停恒生 A 份额与恒生 B 份额的上市交易和添富恒生份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 7、基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

#### 8、特殊情形的处理

若在某一会计年度 1 月份的第 1 个工作日发生《基金合同》约定的本基金不定期份额折算的情形时，基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则，根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

### (二) 不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即：当添富恒生份额的基金份额净值达到或超过 1.500 元；当恒生 B 份额的的份额参考净值达到或低于 0.250 元时。

1、当添富恒生份额的基金份额净值达到或超过 1.500 元，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### (1) 基金份额折算基准日

添富恒生份额的基金份额净值达到 1.500 元，基金管理人可根据市场情况确定折算基准日。

## (2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的恒生 A 份额、恒生 B 份额和添富恒生份额。

## (3) 基金份额折算频率

不定期。

## (4) 基金份额折算方式

当添富恒生份额的基金份额净值达到 1.500 元后, 本基金将分别对恒生 A 份额、恒生 B 份额和添富恒生份额进行份额折算, 份额折算后本基金将确保恒生 A 份额和恒生 B 份额的比例为 1:1, 份额折算后恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额参考净值和添富恒生份额的基金份额净值均调整为 1 元。

当添富恒生份额的份额净值达到 1.500 元后, 恒生 A 份额、恒生 B 份额、添富恒生份额三类份额将按照如下公式进行份额折算:

## 1) 恒生 A 份额

份额折算原则:

① 份额折算前恒生 A 份额的份额数与份额折算后恒生 A 份额的份额数相等;

② 恒生 A 份额持有人份额折算后获得新增的份额数, 即超出 1 元以上的净值部分全部折算为场内添富恒生份额。

$$NUM_{恒生A}^{后} = NUM_{恒生A}^{前}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数

$$= \frac{NUM_{恒生A}^{前} \times (NAV_{恒生A}^{前} - 1.000)}{1.000}$$

其中:

$NUM_{恒生A}^{前}$ : 份额折算前恒生 A 份额的份额数

$NUM_{恒生A}^{后}$ : 份额折算后恒生 A 份额的份额数

$NAV_{恒生A}^{前}$ : 份额折算前恒生 A 份额的参考净值

## 2) 恒生 B 份额

份额折算原则:

① 份额折算后恒生 B 份额与恒生 A 份额的份额数保持 1: 1 配比;

② 份额折算前恒生 B 份额的资产净值与份额折算后恒生 B 份额的资产净值及新增场内添富恒生份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前恒生 B 份额的持有人在份额折算后将持有恒生 B 份额与新增场内添富恒生份额。

恒生 B 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数=

$$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{后}} = \text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{后}}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数=

$$\frac{\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{前}} \times (\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中：

$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后恒生 B 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：份额折算后恒生 A 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 B 份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 B 份额的参考净值

### 3) 添富恒生份额

份额折算原则：

场外添富恒生份额持有人份额折算后获得新增场外添富恒生份额，场内添富恒生份额持有人份额折算后获得新增场内添富恒生份额。

$$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}} = \frac{\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} \times \text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：份额折算后添富恒生份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：份额折算前添富恒生份额净值

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：份额折算前添富恒生份额的份额数

#### (5) 举例：

某投资者持有添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，添富恒生份额的基金份额净值、恒生 A 份额与恒生 B

份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，添富恒生份额的基金份额净值、恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

基金份额	折算前		折算后		
	基金份额净值/参考净值	基金份额	基金份额净值/参考净值	基金份额	新增添富恒生份额
添富恒生	2.070	10,000	1.000	20,700	0
恒生 A	1.030	10,000	1.000	10,000	300
恒生 B	3.110	10,000	1.000	10,000	21,100

在实施不定期份额折算时，恒生 A 份额、恒生 B 份额及添富恒生份额折算的具体计算过程及计算结果以基金管理人届时发布的折算结果公告为准。

#### (6) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停恒生 A 份额与恒生 B 份额的上市交易和添富恒生份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### (7) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

2、恒生 B 份额的单位净值达到或低于 0.250 元时，本基金将按照以下规则进行份额折算。

#### (1) 基金份额折算基准日

当恒生 B 份额的份额参考净值达到或低于 0.250 元时，基金管理人将以净值达到或低于 0.250 元的当日，作为折算基准日。

#### (2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的恒生 A 份额、恒生 B 份额、添富恒生份额。

#### (3) 基金份额折算频率

不定期。

#### (4) 基金份额折算方式

当恒生 B 份额的单位净值达到或低于 0.250 元时，本基金将分别对恒生 A

份额、恒生 B 份额和添富恒生份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保恒生 A 份额和恒生 B 份额的比例为 1: 1，份额折算后添富恒生份额、恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值均调整为 1 元。特别的，若实际折算时，恒生 B 份额的净值跌至负值，恒生 B 份额份额数归零，跌破 0 元以下的损失由恒生 A 份额承担，恒生 A 份额全部折算为添富恒生份额，添富恒生份额净值调整为 1 元。

当恒生 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元时，恒生 A 份额、恒生 B 份额、添富恒生份额三类份额将按照如下公式进行份额折算：

#### 1) 恒生 B 份额

份额折算原则：

在恒生 B 份额的参考净值非负的情况下，份额折算后恒生 B 份额的资产净值与份额折算前恒生 B 份额的资产净值相等。特别的，当恒生 B 份额的参考净值小于 0 时，恒生 B 份额归零。

$$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{后}} = \frac{\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{前}} \times \text{MAX}(\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}, 0)}{1.000}$$

其中：

$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后恒生 B 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 B 份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 B 份额的参考净值

可见，当恒生 B 份额的净值小于或等于 0 时，折算后恒生 B 份额数为 0。

#### 2) 恒生 A 份额

份额折算原则：

①在恒生 B 份额的参考净值为正的情况下，份额折算前后恒生 A 份额与恒生 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比，特别的当恒生 B 份额的净值小于或等于 0 时，恒生 A 份额全部折算为添富恒生份额；

②在恒生 B 份额的参考净值为正的情况下，份额折算前恒生 A 份额的资产净值与份额折算后恒生 A 份额的资产净值及新增场内添富恒生份额的资产净值之和相等。特别的当恒生 B 份额的净值小于或等于 0 时，折算前恒生 A 份额与

恒生 B 份额的资产净值的和与新增场内添富恒生份额的资产净值相等；

③在恒生 B 份额的参考净值为正的情况下，份额折算前恒生 A 份额的持有人在份额折算后将持有恒生 A 份额与新增场内添富恒生份额。特别的当恒生 B 份额的净值小于或等于 0 时，份额折算前恒生 A 份额的持有人在份额折算后将持有全部新增场内添富恒生份额。

$$\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{后}} = \text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{后}}$$

恒生 A 份额持有人新增的场内添富恒生份额的份额数=

$$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{场内}} = \frac{\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} - \text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{后}} \times 1.000}{1.000} \quad (\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}} > 0)$$

$$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{场内}} = \frac{\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}} + \text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}}{1.000} \quad (\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}} \leq 0)$$

其中：

$\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：份额折算后恒生 A 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{后}}$ ：份额折算后恒生 B 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 B 份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{场内}}$ ：份额折算前恒生 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的

场内添富恒生份额的份额数

$\text{NUM}_{\text{恒生A}}^{\text{后}}$ ：份额折算后恒生 A 份额的份额数

$\text{NAV}_{\text{恒生A}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 A 份额的参考净值

$\text{NAV}_{\text{恒生B}}^{\text{前}}$ ：份额折算前恒生 B 份额的参考净值

3) 添富恒生份额：

份额折算原则：

份额折算前添富恒生份额的资产净值与份额折算后添富恒生份额的资产净值相等。

$$\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{后}} = \frac{\text{NUM}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}} \times \text{NAV}_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NUM_{\text{添富恒生}}^{\text{后}}$ ：份额折算后添富恒生份额的份额数

$NUM_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：份额折算前添富恒生份额的份额数

$NAV_{\text{添富恒生}}^{\text{前}}$ ：份额折算前添富恒生份额净值

(5) 举例：

某投资者持有添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各 10,000 份，在本基金的不定期份额折算日，添富恒生份额的基金份额净值、恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额参考净值如下表所示，折算后，添富恒生份额的基金份额净值、恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

基金份额	折算前		折算后		
	基金份额净值/参考净值	基金份额	基金份额净值/参考净值	基金份额	新增添富恒生份额
添富恒生	0.594	10,000	1.000	5,940	0
恒生 A	1.040	10,000	1.000	1,480	8,920
恒生 B	0.148	10,000	1.000	1,480	0

在实施不定期份额折算时，恒生 A 份额、恒生 B 份额及添富恒生份额折算的具体计算过程及计算结果以基金管理人届时发布的折算结果公告为准。

(6) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停恒生 A 份额与恒生 B 份额的上市交易和添富恒生份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(7) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后，基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

(三) 恒生 A 份额与恒生 B 份额的终止运作

1、经基金份额持有人大会决议通过，恒生 A 份额与恒生 B 份额可申请终止运作。恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作后，恒生 A 份额与恒生 B 份额将全部

转换为添富恒生份额的场内份额，本基金转为上市开放式基金（LOF），投资者可通过场内、场外进行基金份额的申购、赎回。

## 2、恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作后的份额转换

恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作后，恒生 A 份额、恒生 B 份额将全部转换成添富恒生份额的场内份额。

### （1）份额转换基准日

恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

### （2）份额转换方式

在转换基准日日终，以添富恒生份额的基金份额净值为基准，恒生 A 份额、恒生 B 份额按照的基金份额参考净值转换成添富恒生份额的场内份额。恒生 A 份额（或恒生 B 份额）基金份额持有人持有的转换后添富恒生份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

恒生 A 份额（或恒生 B 份额）的转换比率 = 份额转换基准日恒生 A 份额（或恒生 B 份额）的基金份额参考净值 / 份额转换基准日添富恒生份额的基金份额净值

恒生 A 份额（或恒生 B 份额）基金份额持有人持有的转换后添富恒生份额的场内份额 = 基金份额持有人持有的转换前恒生 A 份额（或恒生 B 份额）的份额数 × 恒生 A 份额（或恒生 B 份额）的转换比率

### （3）份额转换后的基金运作

恒生 A 份额与恒生 B 份额全部转换为添富恒生份额的场内份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

### （4）份额转换的公告

恒生 A 份额与恒生 B 份额进行份额转换结束后，基金管理人应在指定媒体公告，并报中国证监会备案。



## 二十、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 二十一、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

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媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### (三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；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网站上。

### 2、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媒体上。

### 3、《基金合同》生效公告

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

### 4、《基金上市交易公告书》

恒生 A 份额与恒生 B 份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金上市日前至少 3 个工作日，将基金上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### 5、基金资产净值、基金份额净值/参考净值

《基金合同》生效后，在开始办理添富恒生份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值。

在恒生 A 份额、恒生 B 份额上市交易或开始办理添富恒生份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各自的基金份额净值/参考净值和添富恒生份额的基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各自基金份额净值/参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额基金份额净值/参考净值和添富恒生份额的基金份额累计净值登载在指定媒体上。

#### 6、添富恒生份额申购、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份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

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

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

## 8、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金登记机构；

- (21) 添富恒生份额开始办理申购、赎回；
- (22) 添富恒生份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 添富恒生份额发生巨额赎回并延期办理；
- (24) 添富恒生份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 添富恒生份额暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 本基金接受或暂停接受份额配对转换申请；
- (27) 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
- (28) 本基金实施基金份额折算；
- (29) 恒生 A 份额、恒生 B 份额上市交易、暂停上市、恢复上市或终止上市；；
- (30) 恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作；
- (31) 恒生 A 份额与恒生 B 份额终止运作后恒生 A 份额、恒生 B 份额的份额转换；
- (32) 基金份额持有人大会的决议
- (33) 开通多币种申购、赎回业务
- (34) 选择或更换境外投资顾问、境外资产托管人。
- (35) 基金推出新业务或服务。
- (36) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，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。

## 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

## 11、中国证监会规定的其他信息。

### (六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管

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、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

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

#### **（七）信息披露文件的存放与查阅**

基金合同、托管协议、招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行，自决议生效之日起两日内在指定媒体公告。

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；



- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
  - (3) 对基金财产进行估值和变现；
  - (4) 制作清算报告；
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
  - (7) 对基金剩余财产进行分配。
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### **(四) 清算费用**

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

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

若在基金分级运作内基金合同终止，则本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，根据基金合同两级子份额净值计算原则计算并确定恒生 A 份额和恒生 B 份额基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

若本基金转型为上市开放式基金（LOF）后基金合同终止，则本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **(六) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68121510

传真：010-68121816

联系人：李芳菲

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

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007

年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004 年 9 月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、剪务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止 2014 年 6 月 30 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 213 只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰

货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券

投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金 (LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金 (LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金 (LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲 (除日本) 机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金 (LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理

财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺

长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深300指数型证券投资基金、前海开源沪深300指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金。

## （二）基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

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

### 3、内部控制制度及措施

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

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理



人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 二十四、境外托管人

### (一) 境外资产托管人基本情况

名称：香港上海汇丰银行有限公司

注册地址：香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦

办公地址：香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼

公司网址：[www.hsbc.com](http://www.hsbc.com)

2012年6月30日公司股本：454.04亿港元

2012年6月30日托管资产规模：5.4万亿美元

信用等级：标准普尔 AA-

汇丰集团是全球最大规模的银行及金融服务机构之一，在欧洲，亚太区，美洲，中东及非洲等 87 个国家和地区设有约 8,000 个办事处。

香港上海汇丰银行是汇丰集团的始创成员，于 1865 年 3 月及 4 月先后在香港和上海成立。该行是汇丰集团在亚太区的旗舰，也是香港最大的本地注册银行。

香港上海汇丰银行有限公司股本(Share Capital)截止 2012 年 6 月 30 日为 454.04 亿港币,托管资产达 54,000 亿美元。

### (二) 境外资产托管人职责

- 1、安全保管基金的境外资产，及时办理清算、交割事宜。
- 2、准时将公司行为信息通知基金管理人和/或基金托管人，确保基金及时收取所有应得收入。
- 3、其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 二十五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

（1）汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区大沽路 288 号 6 幢 538 室

办公地址：上海市峨山路 91 弄 61 号 1 幢陆家嘴软件园 10 号楼 3 楼

法定代表人：林利军

电话：（021）28932823

传真：（021）28932998

联系人：丛菲

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

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

（2）汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（[trade.99fund.com](http://trade.99fund.com)）

#### 2、场内代销机构

场内代销机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所场内会员单位。包括爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、开源证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

### 3、场外代销机构

#### 1) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

#### 2) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

#### 3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

网址：<http://www.bankcomm.com/>

#### 4) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

联系人：吴海平

电话：021-38576666

传真：021-50105124

客服电话：021-962999 4006962999

公司网站：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

5) 杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

电话：0571-85108309

传真：0571-85151339

联系人：严峻

客户服务电话：0571-96523 400-8888-508

网址：[www.hzbank.com.cn](http://www.hzbank.com.cn)

6) 哈尔滨银行股份有限公司

住所：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法人：郭志文

联系人：王超

联系电话：0451-86779007

传真：0451-86779218

客服电话：95537、400-60-95537

公司网址：[www.hrbb.com.cn](http://www.hrbb.com.cn)

7) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

开放式基金咨询电话：0755-82558305

开放式基金业务传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

统一客服电话：4008001001

公司网站地址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

8) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

电话：022-28451709

传真：022-28451892

联系人：胡天彤

网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

客户服务电话：400-6515-988

9) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

电话：021-38784818

传真：021-68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：68777877

公司网站：[www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

10) 财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27、28 楼

法定代表人：孙智勇

咨询电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

11) 财通证券有限责任公司

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

注册地：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

12) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

邮政编码：518034

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

13) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

代销资格批准文号：证监基金字【2003】25 号

14) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

开放式基金咨询电话：4008888128

开放式基金业务传真：021-68767032

联系人：叶蕾

联系电话：021-68761616-8522

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

15) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

开放式基金咨询电话：4008881888

开放式基金业务传真：0755-82485081

联系人：崔国良

联系电话：075525832852

网址：www.fcsc.cn

16) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客户服务电话：4006000686 0431-85096733

网址：www.nesc.cn

17) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326729

客户服务热线：95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

18) 东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：4008601555

网址：www.dwzq.com.cn

19) 东兴证券股份有限公司



住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

邮编：100033

法定代表人：魏庆华

基金销售联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

20) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

全国统一客服热线：95571

方正证券网站：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

21) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：袁长清（代行）

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525、4008888788、10108998

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

22) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：刘东

开放式基金咨询电话：020-961303

开放式基金业务传真：020-88836654

联系人：林洁茹

联系电话：020-88836999

## 23) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

开放式基金咨询电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

## 24) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘一宏

客户服务电话：400-660-0109

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

## 25) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

客户服务热线：4008888666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

## 26) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

注册资本：95.85亿元人民币

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：李笑鸣

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

## 27) 恒泰长财证券有限责任公司

注册地址: 吉林省长春市长江路经济开发区人民大街 280 号科技城 2 层 A-33 段

法定代表人: 赵培武

联系人: 吴德森

电话: 0431-82951765

传真: 0431-82946531

网站: [www.cczq.net](http://www.cczq.net)

客服热线: 0431-82951765

## 28) 宏源证券股份有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人: 冯戎

电话: 010-88085858

传真: 010-88085195

联系人: 李巍

客户服务电话: 400-800-0562

网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

## 29) 华安证券股份有限公司

华安证券股份有限公司

注册地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人: 李工

电话: 0551-65161821

传真: 0551-65161672

联系人: 甘霖

客户服务电话: 96518 (安徽)、400-80-96518 (全国)

网址: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

## 30) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

电话：021-6877-8056

传真：021-6877-8113

客户服务电话：400-820-9898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

31) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）。

[公司网址：www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

32) 华龙证券有限责任公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

客服电话：0931-96668、400-689-8888

公司网址：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

33) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单

元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

邮政编码：200030

法定代表人：洪家新

电 话：021-64339000

传 真：021-64333051

34) 江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

35) 联讯证券有限责任公司

注册地址：中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

办公地址：北京市朝阳区红军营南路媒体村天畅园 6 号楼 2 层

法定代表人：徐刚

联系人：丁宁

联系电话：010-64408252

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

36) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-D01 零售业务  
总部市场营销部产品销售部

法定代表人：赵大建

开放式基金咨询电话：400-889-5618

联系人：李微

联系电话：010-59355941

传真：010-66553791

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

## 37) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽 (zhengshuli001@pingan.com.cn,0755-22626391)

网址：<http://www.pingan.com>

## 38) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-6889185

客服电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

## 39) 日信证券有限公司

注册地址：呼和浩特市新城區锡林南路 18 号

联络地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层

法定代表人：孔佑杰

联系人：文思婷

联系电话：010-83991737

网址：[www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

## 40) 瑞银证券有限责任公司

瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号/英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号/英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

电话：010-5832-8112

传真：010-5832-8748

联系人：牟冲

客户服务电话：400-887-8827

网址：[www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

41) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：张瑾

客户服务电话：(021) 962518、4008918918（全国热线）

公司网站：[www.962518.com](http://www.962518.com)

42) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：95523

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

43) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：卢长才

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

网站：[www.csco.com.cn](http://www.csco.com.cn)

客服热线：0755-83199511

44) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

联系人：王鑫

联系电话：020-38286651

邮箱：wangxin@wlzq.com.cn

45) 西藏同信证券有限责任公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

联系人：刘宇

网址：www.xzsec.com

客户服务电话：400-881-1177

46) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

客户服务电话：4008-096-096

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

47) 厦门证券有限公司

地址：厦门市莲前西路 2 号

客户服务电话：0592-5163588

公司网址：[www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn)

48) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680



联系人：赵小明 021-68634510-8620

客服电话：400-888-1551

公司网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

49) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

开放式基金咨询电话：400-698-9898

开放式基金业务传真：010-83561094

联系人：孙恺

联系电话：010-83561149

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

50) 信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

51) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

邮政编码：350003

法定代表人：兰荣

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

邮政编码：200135

客服电话：95562

业务联系电话：0591-38162212

业务联系人：黄英

传真：0591-38507538

52) 招商证券股份有限公司

招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务电话：95565、4008888111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

53) 浙商证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区 6-7 层

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 区 6-7 层

电话：0571-87901908、0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：刘虹、谢项辉

客户服务电话：0571-967777

公司网址：[www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn)

邮编：310007

54) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

电话：0791-86768681

联系人：戴蕾

客户服务电话：400-8866-567

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

55) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

邮政编码：100022

注册资本：1.25 亿美元

法定代表人：金立群

电话：010-65051166

传真：010-85679535

56) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

客服电话：400-600-8008、95532

57) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人姓名：王常青

基金业务对外联系人：权唐

联系电话：400-8888-108

联系传真：010-65182261

公司网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

客服电话：400-8888-108

58) 中信万通证券有限责任公司

法定代表人：杨宝林

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层  
(266061)

基金业务联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

59) 中信证券股份有限公司

住址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-84588888

传真：010-84865560

联系人：陈忠

公司网址：[www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

60) 中信证券（浙江）有限责任公司

公司注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20  
层

公司办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20  
层

法人代表：沈强

邮政编码：310052

联系人：王霏霏

联系电话：95548

公司网站：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

61) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳、耿铭

联系电话：0371—65585670

联系传真：0371—65585665

客服电话：967218（郑州市外客户需要加拨区号 0371）、400-813-9666

网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

62) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层 邮编：100033

法定代表人：林义相

联系电话：010-66045608

客服电话：010-66045678

传真：010-66045549

联系人：林爽

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

63) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 邮编：518001

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元 邮编：518001

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

64) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

邮政编码：200235

注册资本：人民币伍千万元

法定代表人： 其实

电 话： 021-54509998 传 真： 021-64385308

65) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

邮政编码：200120

法定代表人：杨文斌

电 话： 021-58870011

传 真： 021-68596919

66) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

67) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021—58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

68) 浙江同花顺基金销售有限公司

地 址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

邮 编：310012

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

传 真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

或访问同花顺旗下基金网站——爱基金网 www.5ifund.com

69) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

邮政编码：100029

法定代表人：闫振杰

电 话：010-62020088

传 真：010-62020088-8002

70) 中期时代基金销售（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层

法定代表人：路瑶

电话：010-65807865

传真：010-65807868

客服电话：95162 4008888160

网址：www.cifcofund.com

71) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：于海锋

电话：028-82000996

传真：028-82000996-805

客服电话：4008-588-588

网址：<http://www.pyfund.cn/>

## 72) 万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

法定代表人：李招弟

电话：010-59393923

传真：010 -59393074

客服电话：400-808-0069

网址：www.wy-fund.com

## 73) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

联系人：孙晋峰

网址：www.zcvc.com.cn 客户服务电话：400-001-8811

## 74) 和讯信息科技有限公司

和讯网基金销售平台——理财客信息

公司地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 18 楼

公司总机：021-20835888

客服热线：400-920-0022

客服邮箱：licaike@hexunfsd.com

市场部联系方式：021-20835820 18616506925

基金销售部联系方式：13911468997

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

**(二) 登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

地址：北京市西城区太平桥大街 17 号



法定代表人：周明

联系人：严峰、朱立元

电话：（0755）25946013、（010）59378839

传真：（010）59378907

### （三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：吕红、黎明

联系人：黎明

### （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）

首席合伙人：吴港平

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

邮政编码：100738

公司电话：（010）58153000

公司传真：（010）85188298

签章会计师：陈露、方侃

业务联系人：方侃

## 二十六、基金合同的内容摘要

### 〈一〉基金合同当事人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

本基金除恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额参考净值计算、基金份额折算、基金合同终止时的基金清算财产分配，同一类别范围内每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回其持有的添富恒生份额，依法转让其持有的恒生 A 份额与恒生 B 份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》；

- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- (17) 在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高基金托管费、基金管理费之外的基金费率结构和收费方式；
- (18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；
- (6) 与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行；
- (7) 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；
- (8) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，

保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;

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

(10) 依法接受基金托管人的监督;

(11) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定;

(12) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(13) 编制季度、半年度和年度基金报告;

(14) 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;

(15) 计算基金管理人计算的基金资产净值、添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值、基金份额折算比例和添富恒生份额的申购、赎回价格;

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

(17) 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;

(18) 按规定受理申购与赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

(19) 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;

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

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

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

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

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

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

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

(27) 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；

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

(29) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(30) 建立并保存基金份额持有人名册；

(31) 法律法规及中国证监会、外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

- (4) 选择、更换或撤销境外托管人；
- (5) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；
- (6) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (7) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值、基金份额折算比例和添富恒生份额的申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了

适当的措施；

(11) 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；其它基金托管业务活动的相关资料的保存时间应不少于 15 年；

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

(13) 建立并保存基金份额持有人名册；

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

(17) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责。境外托管人依据基金财产投资地法律法规、监管要求、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人之间的主次托管协议持有、保管基金财产，并履行资金清算等职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致基金财产受损的，基金托管人承担相应责任。在决定境外托管人是否有过错、疏忽等不当行为时，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议的适用法律及当地



法律法规和市场惯例决定；

(24) 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；

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

(26) 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；

(27) 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；

(28) 法律法规及中国证监会、外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 〈二〉基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人大会的审议事项应分别由添富恒生份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或中国证监会要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止恒生 A 份额与恒生 B 份额的运作；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各自基金总份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整添富恒生份额的申购费率、调低赎回费率；
- (4) 基金管理人、基金记机构、基金销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；
- (5) 在不违反法律法规规定的情况下，增加、减少或调整基金销售币种；
- (6) 在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值/参考净值的计算和公告时间或频率；
- (7) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (8) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## **(二) 会议召集人及召集方式**

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

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

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

### **（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式**

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

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

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额不少于在权益登记日各自基金

总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，有效的添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额不少于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2) 通讯开会

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

## (六) 表决

添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应级别内享有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一

般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额基金份额持有人或其代理人各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

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

## <三>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基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公



告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行，自决议生效之日起两日内在指定媒体公告。

## （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

## （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

(7) 对基金剩余财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### **(四) 清算费用**

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

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

若在基金分级运作内基金合同终止，则本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，根据基金合同两级子份额净值计算原则计算并确定恒生 A 份额和恒生 B 份额基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

若本基金转型为上市开放式基金（LOF）后基金合同终止，则本基金依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **(六) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **(七) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### **<四> 争议的处理**

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### **<五>基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

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

## 二十七、基金托管协议的内容摘要

### 〈一〉基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：汇添富基金管理股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区大沽路 288 号 6 幢 538 室

办公地址：上海市浦东新区富城路 99 号震旦大厦 22 楼

邮政编码：200120

法定代表人：林利军

成立日期：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】5 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：壹亿元

存续期间：持续经营

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

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68121510

传真：010-68121816

联系人：李芳菲

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 〈二〉基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同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

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于债券、基金（包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等）、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金非现金资产的 80%。

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

### 2、对基金投融资比例进行监督

#### （1）组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金非现金资产的 80%。

2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

3) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

4) 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不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

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资产净值的 10%。

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

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

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

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

9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

若基金超过上述 3) -8) 项投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

基金管理人应当自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需经基金份额持有人大会审议。

## （2）金融衍生品投资

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

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

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

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

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

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

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

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

5) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

## （3）证券借贷交易

本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

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

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

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

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

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

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

6) 本基金管理人将对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

#### (4) 证券回购交易

基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

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

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

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

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

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

基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。基金如参与证券借贷交易、正回购交易、逆回购交易，本基金管理人将按照规定建立适当的内控制度、操作程序和进行档案管理。

3、根据基金合同及本协议对投资禁止行为的约定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；

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。基金托管人只对进行金融衍生品、证券借贷、回购交易之交易对手作出监督。监督范围并不包括一般证券买卖之券商。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。

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各自基金份额净值/参考净值计算、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复核。

(三) 基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时通知基金管理人，由基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正，基金托管人应报告中国证监会。

(四) 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违规或违约行为，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。

(五) 基金托管人对投资管理人对基金财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。

(六) 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。

(七) 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

(一) 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添富恒生份额、恒生 A 份额、恒生 B 份额各自基金份额净值/参考净值、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。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、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。

(三) 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

### 〈四〉基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和境外托管人的固有财产。
- 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。

8、除非根据基金管理人书面同意，基金托管人自身，并确保境外托管人不得在任何基金财产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押等，但根据有关适用法律的规定因基金投资而产生的担保权利除外。

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司开立的“基金认购专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合基金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。

#### （三）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。

#### （四）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基金托管人处，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。

#### （五）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进行开立。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。

#### （六）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。属于基金托管人及其境外托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担，但基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （七）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15年。

#### <五> 基金资产净值的计算和会计核算

本基金作为分级基金，按照恒生 A 份额和恒生 B 份额的参考净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日添富恒生份额、恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值：

##### 1、添富恒生份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日添富恒生份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金，T 日本基金基金份额的总数为恒生 A 份额、恒生 B 份额和添富恒生份额的份额数之和。

##### 2、恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_{\text{恒生A}} = (1 + R)^{\frac{t}{N}}$$

$$NAV_{\text{恒生B}} = (2 \square NAV_{\text{添富恒生}} - NAV_{\text{恒生A}})$$

设 T 日为基金份额净值计算日，T=1, 2, 3……N；N 为当年实际天数；t=min{自基金合同生效日至 T 日，自最近一次份额折算日至 T 日}；

$NAV_{\text{添富恒生}}$  为 T 日每份添富恒生份额的基金份额净值； $NAV_{\text{恒生A}}$  为 T 日恒生 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{恒生B}}$  为 T 日恒生 B 份额的基金份额参考净值；R 为恒生 A 份额约定年基准收益率。

添富恒生份额、恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额净值/参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。特别的，在基金运作的折算基准日，添富恒生份额和恒生 B 份额的基金份额参考净值的计算结果保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入。

T 日的恒生 A 份额和恒生 B 份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日与添富恒生份额的基金份额净值一同公告。公告的基金份额净值/参考

净值均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 3、复核程序

基金管理人每个工作日对基金进行估值，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。基金管理人应于每个估值日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并以约定方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以约定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。

## <六> 基金份额持有人名册的保管

### （一）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但不限于以下几类：

- 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权益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。

### （二）基金份额持有人名册的提供与保管

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管与各自职责相关的基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将基金份额持有人名册等有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。

## <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，如经友好协商未能解决的，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> 托管协议的变更、终止与财产的清算**

### **（一）托管协议的修改程序**

本协议经双方当事人协商一致，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或备案后生效。

### **（二）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》、《试行办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十八、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场变化，增加或变更服务项目，以下是基金管理人提供的主要服务内容：

### （一）客户服务中心电话服务

投资者拨打基金管理人客服热线 400-888-9918（国内免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务：提供 7×24 小时电话自助语音的服务，可进行基金净值、基金产品、最新公告信息等自助查询服务。

2、人工坐席服务：提供每周五天，每天不少于 12 小时的人工坐席服务（法定节假日除外）。

### （二）网上客户服务

基金管理人网站（[www.99fund.com](http://www.99fund.com)）为投资者提供账户查询、信息定制、公司公告、理财刊物等信息资讯服务。同时，网站还设有电子邮箱服务（客户服务邮箱：[service@99fund.com](mailto:service@99fund.com)）和网上在线答疑服务。

### （三）客户投诉建议受理服务

投资者可以通过基金管理人或销售机构的客服热线、网站在线栏目、电子邮件及信函等渠道进行投诉或提出建议。对于工作日期间受理的投诉或建议，原则上是及时回复；对于不能及时回复的，基金管理人承诺在 24 小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉或建议，将在顺延的工作日当日完成回复。



## 二十九、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人的公司网站(www.99fund.com)进行公开披露，并已报送相关监管部门备案。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-03-07
2	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-02
3	汇添富恒生指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-03
4	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金参加部分销售机构定投基金、电子渠道申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-03
5	汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A、恒生 B 基金份额上市交易公告书	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-08
6	汇添富基金管理股份有限公司关于客服中心变更办公地址的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2014-04-10
7	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告_	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-11
8	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生 A、恒生 B 基金份额上市交易提示性公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-11
9	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 4 月 18 日、4 月 21 日因境外市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-16

	的公告		
10	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-21
11	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 5 月 6 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-04-30
12	汇添富基金管理股份有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2014-06-10
13	汇添富基金汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为销售机构的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-06-11
14	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-06-27
15	汇添富基金管理股份有限公司关于香港子公司办公地址变更的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2014-07-01
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2014 年上半年度资产净值的公告	管理人网站	2014-07-01
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华龙证券开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-07-07
18	汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年第 2 季度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-07-19
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华龙证券开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2014-07-24
20	汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-08-25

		所	
21	汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告摘要	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-08-25
22	汇添富基金管理有限公司澄清公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2014-08-29
23	汇添富基金管理股份有限公司澄清公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站	2014-09-03
24	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金 2014 年 9 月 9 日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,管理人网站,深交所	2014-09-05

### 三十、招募说明书的存放及查阅方式

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

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

## 三十一、备查文件

### （一）本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

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

汇添富基金管理股份有限公司

2014年10月20日