

华泰柏瑞基金管理有限公司

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

更新的招募说明书

2023 年第 1 号

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇二三年六月

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金（更新）

重要提示

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2007 年 5 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准友邦华泰积极成长混合型证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2007】131 号）和 2007 年 5 月 14 日《关于友邦华泰积极成长混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2007】120 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2007 年 5 月 29 日正式生效。

经中国证监会批准，自 2010 年 4 月 30 日起，基金管理人中文名称由“友邦华泰基金管理有限公司”变更为“华泰柏瑞基金管理有限公司”。经基金托管人同意，并报请中国证监会批准，本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起，由“友邦华泰积极成长混合型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞积极成长混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

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

本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，具体详见本招募说明书中“基金的风险揭示”章节。

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

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

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2023 年 05 月 27 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2023 年 03 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

目录

一、绪言.....	2
二、释义.....	3
三、基金管理人.....	8
四、基金托管人.....	16
五、相关服务机构.....	18
六、基金的募集.....	38
七、基金合同的生效.....	42
八、赎回与转换.....	43
九、基金的非交易过户、转托管、冻结、质押及其他业务.....	52
十、基金的投资.....	53
十一、基金的业绩.....	62
十二、基金的财产.....	64
十三、基金财产的估值.....	65
十四、基金的收益与分配.....	69
十五、基金的费用与税收.....	71
十六、基金的会计与审计.....	75
十七、基金的信息披露.....	76
十八、基金的风险揭示.....	80
十九、终止与基金财产的清算.....	84
二十、基金合同的内容摘要.....	86
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	99
二十二、对基金份额持有人的服务.....	109
二十三、其他应披露事项.....	111
二十四、招募说明书存放及查阅方式.....	113
二十五、备查文件.....	114

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险规定》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

二、释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金：	指华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金；
基金合同或本基金合同或本合同：	指《华泰柏瑞积极成长混合型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；
招募说明书：	指《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
发售公告：	指《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金份额发售公告》；
托管协议：	指《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
基金产品资料概要：	指《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银保监会：	指中国银行保险监督管理委员会；
香港证监会：	指香港证券及期货事务监察委员会；
《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的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》：	指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
《流动性风险规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；
元：	指人民币元；

- 基金管理人：指华泰柏瑞基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：指根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资人；
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
- 投资人：指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人；
- 个人投资人：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 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；
- 基金份额持有人大会：指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
- 基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；
- 基金合同生效日：指基金募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
- 存续期：指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

- 认购：指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
- 基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
- 转托管：指基金份额持有人将其持有的同一基金账户内的某一基金的基金份额从一个交易账户转入另一交易账户的行为；
- 投资指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
- 销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；
- 基金销售网点：指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
- 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
- 基金账户：指注册登记机构为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：指销售机构为投资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开放式基金份额的变动及结余情况的账户；
- 开放日：指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- T日：指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T+n日：指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；

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、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;
基金资产总值:	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和;
基金资产净值:	指以计算日基金资产总值减去以计算日基金负债后的价值;
基金份额净值:	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值;
流动性受限资产:	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券,因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等;
基金资产估值:	指计算、评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
法律法规:	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
基金互认:	指中国证监会与香港证监会于 2015 年 5 月 22 日公布并于 2015 年 7 月 1 日开始实施的内地与香港公开募集证券投资基金互认计划;
基金份额分类:	指本基金分设两类基金份额: A 类份额和 H 类份额。两类基金份额分设不同的基金代码;
A 类份额:	指在中国内地市场销售的基金份额;
H 类份额:	指通过基金互认, 仅在香港地区销售的基金份额;
香港代表:	指按照《有关内地与香港基金互认的通函》等法律法规担任本基金在香港地区的代表, 负责接收香港地区投资者/机构的申购赎回申请、协调基金销售、向香港证监会进行报备和香港基金投资人的信息披露和沟通工作等依据香港法规应履行的职责;
香港销售机构:	指香港证监会批准的, 具备基金销售资格的代为办理

本基金 H 类份额申购、赎回和其他基金业务的相关销售机构；

名义持有人：指依据香港市场的特点，香港代表或香港销售机构将代表投资者名义持有人“内地互认基金”（H类份额）的基金份额，并出现在注册登记机构的持有人名册中；

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

三、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

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

法定代表人：贾波

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：汪莹白

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：PineBridge Investments LLC49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

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

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

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

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

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

韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007 年 7 月至 2011 年 9 月任华安基金管理有限公司副总经理。2011 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

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

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

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

陆楨女士：独立董事，硕士，曾任中国金融租赁有限公司副总经理、北京启迪清云智慧能源有限公司高级副总裁，2018 年至今任融讯商业保理（深圳）有限公司创始人兼 CEO，2019 年至今任北京清谊厚泽投资有限公司副总裁。

2、监事会成员

刘晓冰先生：监事长，二十七年证券从业经历。1993 年 12 月进入公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

卞时珍女士：监事，学士，曾任职于毕马威会计师事务所、安永会计师事务所、苏格兰皇家银行集团、CIT 集团股份、AIG 美国国际集团、富卫集团有限公司，2022 年 9 月起担任柏瑞投资亚洲有限公司亚洲财务部主管。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交

易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年3月至2018年11月任华泰柏瑞瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月至2018年10月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018年10月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年12月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年7月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年9月至2021年4月任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年2月至2021年4月任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年9月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年3月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021年5月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年7月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年8月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月起任华泰柏瑞中证500增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022年11月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年3月起任华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。

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

3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

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

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

田汉卿女士：副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013年8月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013年10月起任公司副总经理，2014年12月至2020年7月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年3月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理，2015年3月至2020年7月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2021年11月任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月起任华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年5月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017年3月至2018年11月任华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月至2020年7月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年11月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。2020年12月起任华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金的基金经理。2021年12月起任华泰柏瑞中证500增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年4月起任华泰柏瑞中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

李晓西先生：副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018年8月起任公司副总经理，现任公司副总经理兼投资一部总监。2020年2月至2022年7月任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金的基金经理。2020年2月起任华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年3月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。2021年1月至2022年9月任华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金的基金经理。2021年3月起任华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金的基金经理。

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

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

童辉先生：首席信息官，硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司程序员，

1998-2004 年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任首席信息官兼信息技术部总监。

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

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

4、本基金基金经理

陆从珍女士，复旦大学经济学硕士。历任上海市工商局职员；京华山一证券上海公司高级研究员；中企东方资产管理公司高级研究员；东方证券研究部资深研究员；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员、基金经理。2015 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2020 年 7 月起任华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起任华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金的基金经理。

历任本基金基金经理：

秦岭松先生，2007 年 5 月至 2012 年 2 月担任本基金基金经理。

卞亚军先生，2011 年 1 月至 2012 年 4 月担任本基金基金经理。

方伦煜先生，2012 年 4 月至 2020 年 7 月担任本基金基金经理。

5、权益投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理田汉卿女士；副总经理李晓西先生；总经理助理沈雪峰女士；总经理助理张慧先生；联席主动权益投资总监方纬先生；主动权益投资副总监吕慧建先生；研究部总监莫倩女士。

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

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经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、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其它职责。

（四）基金管理人的承诺

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、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；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

(5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

(6) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

(1) 控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委

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

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

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

(2) 风险评估

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

(3) 控制活动

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

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

(4) 信息与沟通

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

(5) 内部监控

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

3、基金管理人关于内部控制的声明

- (1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- (2) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

（三）证券投资基金托管情况

截至2022年3月31日，中国银行已托管1006只证券投资基金，其中境内基金958只，QDII基金48只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

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

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

基金份额 A 类份额发售机构包括基金管理人的直销机构和 A 类份额代销机构的销售网点。

1、直销机构

华泰柏瑞基金管理有限公司

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

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

法定代表人：贾波

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：汪莹白

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：www.huatai-pb.com

2、A 类份额代销机构

1) 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：任德奇

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

2) 杭州银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市下城区庆春路 46 号

办公地址：浙江省杭州市下城区庆春路 46 号

法定代表人：宋剑斌

客服电话：95398

公司网站：www.hzbank.com.cn

3) 江苏银行股份有限公司

注册地址：中国江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：中国江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

联系人：张洪玮

电话：025-58587036

传真：025-58588720

客服电话：95319

公司网址：www.jsbchina.cn

4) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

传真：(010) 66275654

客服电话：95533

公司网址：www.ccb.com

5) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

传真：0755-82080386

客服电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

6) 广发银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广东省广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

客服电话：4008308003

公司网址：www.cgbchina.com.cn

7) 苏州银行股份有限公司

注册地址：中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

电话：0512-69868373

客服电话：96067

公司网址：www.suzhoubank.com

8) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

传真：（010）66107914

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

9) 嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

办公地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人：许洪明

客服电话：0573-96528

公司网址：www.bojx.com

10) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

11) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客服电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

12) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：霍学文

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

13) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

14) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘建军

客服电话：95580

公司网址：www.psbcb.com

15) 徽商银行股份有限公司

注册地址：安徽合肥安庆路 79 号天徽大厦 A 座

办公地址：安徽合肥安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：李宏鸣

客服电话：96588

公司网址：www.hsbank.com.cn

16) 中国银行股份有限公司

注册地址：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：刘连舸

客服电话：95566

公司网址：www.boc.cn

17) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

公司网址：www.nbcb.com.cn

18) 哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：郭志文

客服电话：95537 或 400-609-5537

公司网址：www.hrbb.com.cn

19) 浙商银行股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

办公地址：浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张荣森(代)

客服电话：95527

公司网址：www.czbank.com

20) 恒丰银行股份有限公司

注册地址：山东省济南市历下区泺源大街 8 号

办公地址：上海市黄浦区开平路 88 号瀛通绿地大厦

法定代表人：陈颖

公司网址：www.hfbank.com.cn

客服电话：95395

21) 泉州银行股份有限公司

注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

办公地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

公司网址：www.qzccb.com

客服电话：400-88-96312

22) 招商银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

23) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层？

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

24) 华泰期货有限公司

注册地址：广东省广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层

办公地址：广东省广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层

法定代表人：胡智

客服电话：400-628-0888

公司网址：www.htfc.com

25) 上海东证期货有限公司

上海东证期货有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 500 号期货大厦 14 楼

办公地址：上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 22 楼

法定代表人：卢大印

客服电话：95503

公司网址：www.dzqh.com.cn

26) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

27) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：祁建邦

客服电话：（0931）4890100、4890619、4890618

公司网址：www.hlzqgs.com

28) 中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

客服电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

29) 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

客服电话：95377

公司网址：www.ccnew.com

30) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：李永湖

客服电话：95329

公司网址：www.zszq.com

31) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：中国武汉武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

客服电话：400-800-5000

公司网址：www.tfzq.com

32) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

33) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座15-19层

法定代表人：施华

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

34) 联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层联储证券

法定代表人：吕春卫

客服电话：400-620-6868

公司网址：www.lczq.com

35) 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：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座16层

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

36) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

37) 甬兴证券有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

办公地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

法定代表人：李抱

公司网址：www.yongxingsec.com

客服电话：400-916-0666

38) 万联证券股份有限公司

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：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：王达

客服电话：95322

公司网址：www.wlzq.cn

39) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：王怡里

客服电话：400-666-1618、(0351) 95573

公司网址：www.i618.com.cn

40) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市福山路 500 号 26 楼

办公地址：上海市福山路 500 号 26 楼

法定代表人：姚文平

客服电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

41) 中信证券华南股份有限公司

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：胡伏云

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

42) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

43) 华金证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区天目西路 128 号 1902 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 27 层（陆家嘴世纪金融广场 2 号楼）

法定代表人：燕文波

客户服务电话：956011

公司网站：<https://www.huajinsc.cn>

44) 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：吴坚

客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn

45) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

客服电话：400-910-1166

公司网址：www.cicc.com.cn

46) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)12、15 层

法定代表人：李娟

客服电话：95309

公司网址：www.dxzq.net

47) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

48) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

49) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

客服电话：400-888-8123

公司网址：www.xyzq.com.cn

50) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

51) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：余维佳

客服电话：4008323000

公司网址：<http://www.csco.com.cn>

52) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：沈和付

客服电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

53) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼机构事业部

法定代表人：张纳沙

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

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

客服电话：400-886-6567

公司网址：www.avicsec.com

55) 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：上海市肇家浜路 750 号

法定代表人：俞洋

客服电话：400-109-9918、021-32109999、029-68918888

公司网址：www.cfsc.com.cn

56) 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 21-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

57) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客服电话：4008608866

公司网址：www.kysec.cn

58) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：杨玉成

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

59) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：徐朝晖

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

60) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信大厦 4, 15 楼

法定代表人：裘强

客服电话：(0791) 6285337

公司网址：www.gsstock.com

61) 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：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

62) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511*8

公司网址：stock.pingan.com

63) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层

办公地址：深圳市福田区大百汇广场 12 楼

法定代表人：严亦斌

客户服务电话：95564

公司网址：<http://www.ykzq.com>

64) 渤海证券股份有限公司

注册地址：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：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：安志勇

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.ewww.com.cn

65) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

66) 中天证券有限责任公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 号甲

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 号甲

法定代表人：李安有

客服电话：400-6180-315

网址：www.iztzq.com

67) 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：章宏韬

客服电话：400-809-6518（全国） 96518（安徽）

公司网址：www.hazq.com

68) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：何伟

客服电话：400-891-8918

公司网址：www.shzq.com

69) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

70) 南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：李剑锋

客服电话：95386

公司网址：www.njzq.com.cn

71) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：王献军

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

72) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

客服电话：4008-888-888、95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

73) 大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

法定代表人：董祥

客服电话：400-712-1212

公司网址：www.dtsbc.com.cn

74) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客服电话：95584

公司网址：www.hx168.com.cn

75) 财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客服电话：96336（浙江），400-869-6336（全国）

公司网址：www.ctsec.com

76) 华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法定代表人：刘加海

联系人：闪雨晴

电话：021-20321056

传真：68777992

客服电话：4008209898

公司网址：www.cnhbstock.com

77) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

客服电话：（0571）95345

公司网址：www.stocke.com.cn

78) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

79) 财信证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

法定代表人：刘宛晨

联系人：郭静

电话：（0731）84403347

传真：（0731）84403347

客服电话：400-88-35316

公司网址：www.cfzq.com

80) 民生证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 8 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 8 号

法定代表人：景忠

联系人：刘玥

电话：021-80508592

传真：010-85127641

客服电话：95376

公司网址：www.msq.com

81) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑恒泰证券办公楼 7 楼

法定代表人：祝艳辉

客服电话：956088

公司网址：www.cnht.com.cn

82) 国都证券股份有限公司

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：翁振杰

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

83) 大通证券股份有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦
38、39 层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦

38、39 层

法定代表人：赵玺

客服电话：4008-169-169

公司网址：www.daton.com.cn

84) 爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

客服电话：4001-962502

公司网站: www.ajzq.com

85) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

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: 祝瑞敏

客服电话: 95321

公司网址: www.cindasc.com

86) 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: 刘秋明

客服电话: 95525

公司网址: www.ebscn.com

87) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 山东省济南市经七路86号

办公地址: 山东省济南市经七路86号23层

法定代表人: 李玮

客服电话: 95538

公司网址: www.zts.com.cn

88) 长江证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址: 湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人: 尤习贵

客服电话: 95579 或 4008-888-999

公司网址: www.95579.com

89) 国新证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦

法定代表人: 张海文

客服电话: 95390

公司网址: www.crsec.com.cn

90) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址: 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

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)

法定代表人：陈佳春

客服电话：95548

公司网址：sd.citics.com

91) 中国国际期货股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 6 层 609 号、610 号

办公地址：北京市朝阳区光华路 16 号中期大厦 B 座 4 层

法定代表人：王兵

客服电话：95162

公司网站：www.cifco.net

92) 和合期货有限公司

注册地址：山西省太原市迎泽区菜园东街 2 号

办公地址：山西省太原市迎泽区菜园东街 2 号

法定代表人：刘晓洁

客服电话：4006004882

公司网站：www.hhqh.com.cn

93) 大有期货有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

办公地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

法定代表人：沈众辉

客服电话：4006 365 058

公司网站：www.dayouf.com

94) 徽商期货有限责任公司

注册地址：芜湖路 258 号

办公地址：芜湖路 258 号

法定代表人：吴国华

客服电话：400 887 8707

公司网站：www.hsqh.net

95) 中国中金财富证券有限公司

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：高涛

客服电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

96) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：董一锋

电话：0571—88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

97) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客服电话：4006199059

公司网址：www.hcjijin.com

98) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号北美广场 A 座 1002 室

法定代表人：王翔

客服电话：4008-205-369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

99) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166

公司网址：www.huilinbd.com

3、H 类份额的销售机构为具备基金销售资格的由香港代表选聘或基金管理人直接选聘的相关销售机构。

4、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时在基金管理人网站公示。

(二) 注册登记机构

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

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

法定代表人：贾波

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

电话：（021）38601777

传真：（021）38601799

联系人：赵景云

(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

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：秦悦民、王利民

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：朱宏宇、朱寅婷

联系人：胡莲莲

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经 2007 年 5 月 8 日中国证监会《关于核准华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2007】131 号）核准募集。

（一）基金类型

契约型开放式，混合型基金

（二）基金存续期

不定期

（三）募集方式和销售场所

自 2007 年 5 月 22 日至 2007 年 6 月 21 日，本基金通过基金管理人的直销中心和中国银行、华泰证券等代销机构的销售网点公开发售。

投资者还可在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款后，通过登录本公司网站（www.huatai-pb.com）办理开户、认购等业务，有关基金网上交易的开通范围和具体业务规则请登录本公司网站查询。

具体销售城市名单、销售机构联系方式以及发售方案以发售公告为准，请投资者就募集和认购的具体事宜仔细阅读《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金份额发售公告》。

（四）募集期限

本基金自 2007 年 5 月 22 日至 2007 年 6 月 21 日公开发售。根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可继续销售，但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售。

（五）募集对象

中华人民共和国境内的个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（六）募集规模

本基金最低募集规模不低于 2 亿份。本基金募集规模上限为 100 亿元。募集规模具体控制方案请参见发售公告。

（七）基金的面值

本基金初始面值为 1 元。

（八）投资人对基金份额的认购

1、认购方法

投资人认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在发售公告中确定并披露。本基金的实际发售时间为 2007 年 5 月 22 日至 2007 年 5 月 24 日。

2、认购的方式及确认

（1）本基金认购采取金额认购的方式。

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

（3）基金投资人在募集期内可以多次认购，认购一经受理不得撤消。

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

3、认购的限额

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

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

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

4、认购费率

本基金采取金额认购方式，认购费率最高不超过认购金额的 1.0%。

认购金额（元）	认购费率
认购金额<50 万	1.0%
50 万≤认购金额< 100 万	0.8%
100 万≤认购金额<200 万	0.6%
200 万≤认购金额< 500 万	0.4%
认购金额≥500 万	1000 元/笔

投资者重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例配售方

式对有效认购金额进行部分确认时，投资者认购费率按照认购申请确认金额所对应的费率计算。采取比例配售方式对有效认购金额进行部分确认时，将导致有效认购金额低于申请认购金额，可能会出现认购费用的适用费率高于申请认购金额对应费率的情况，敬请投资人注意。

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

5、认购份额的计算

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

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

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购期利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

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

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

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1\%) = 9,900.99 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (9,900.99 + 10) / 1.00 = 9,910.99 \text{ 份}$$

即投资人投资 10,000 元认购本基金，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 9,910.99 份基金份额。

（九）募集资金及利息的处理

- 1、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。
- 2、有效认购资金在募集期间产生的利息折成基金份额，归投资人所有。利息折算成基金份额，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。利息的计算和折算的基金份额的具体数额以注册登记机构的计算结果为准。该部分份额享受免除认购费的优惠。
- 3、基金合同生效前，投资者的认购款项只能存入商业银行，不得动用。

（十）募集结果

截至 2007 年 5 月 24 日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集金额总额为 8,921,315,668.58 元人民币(含募集期间利息 867,410.63 元)。

募集资金已于 2007 年 5 月 28 日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 228,310 户,按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算,募集基金份额总额为 8,921,315,668.58 份(含募集期间利息折基金份额),已全部计入投资者账户,归投资者所有。

根据《基金法》及其配套法规和《招募说明书》、《基金合同》的有关规定,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于 2007 年 5 月 29 日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

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

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

（二）基金的备案

基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。
- 3、本基金的基金合同已于 2007 年 5 月 29 日正式生效。

（四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金基金合同生效期间，连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会，说明出现上述情况的原因及解决方案，法律法规另有规定的，按其规定办理。

八、赎回与转换

本基金根据销售地区的不同，将基金份额分为 A 类和 H 类不同的类别。在中国内地销售的基金份额为 A 类份额，通过基金互认在香港地区销售的基金份额为 H 类份额。A 类和 H 类份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

除本基金的有关公告（例如本基金为在香港销售编制的招募说明书补充文件）及香港销售机构的业务规则另有专门规定外，本基金 H 类份额在香港的申购、赎回及转换等销售业务，应当根据本基金的招募说明书办理。

（一）申购、赎回与转换办理的场所以

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。H 类份额的销售机构为经香港证监会批准的，具备基金销售资格的由香港代表选聘或基金管理人直接选聘的相关销售机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购、赎回与转换。

（二）申购、赎回与转换办理的时间

1、开放日及开放时间

本基金 A 类份额的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。H 类份额的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所及香港交易所的共同交易日。具体业务办理时间以销售机构规定为准。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。

2、申购、赎回与转换的开始时间

本基金的申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理。

H 类份额开始办理日常申购、赎回业务的时间具体在招募说明书补充文件或其他相关公告中载明。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 2 个工作日在指定媒介公告。

本基金的转换开始时间请见基金管理人的具体公告。

3、不得在基金合同约定之外的日期或时间办理基金的申购、赎回与转换；投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回与转换申请的，其基金份额申购、赎回与转换价格为下次办理基金份额申购、赎回与转换时间所在开放日的价格。

（三）申购、赎回与转换的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、赎回与转换价格以受理申请当日收市后计算的各类份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、本基金采用金额申购、份额赎回和份额转出的方式，即申购以金额申请，赎回和转换以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回 A 类份额与申请基金转换时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的 A 类份额进行处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回或转出，申购确认日期在后的基金份额后赎回或转出，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购、赎回与转换申请可以在当日交易时间结束以前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日 3 个工作日前在中国证监会指定媒介上公告。

（四）申购、赎回与转换的程序

1、申购、赎回与转换的申请方式

基金投资人须按销售机构规定的手续，在规定的开放日的业务办理时间提出申购、赎回与转换的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则其提交的申购申请无效，不予成交。

投资人提交赎回或转换申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的可用基金份额余额。否则其提交的赎回或转换申请无效，不予成交。

2、申购、赎回与转换申请的确认

基金管理人应以收到申购、赎回与转换申请的当天作为申购或赎回申请日，并在收到申请后的下一个工作日（T+1 日）内对该交易的有效性进行确认。

H 类份额的开放日与 A 类份额的开放日有所不同，因此本基金 H 类份额的投资者向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况的具体时间见相关公告的规定。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资人账户。投资人赎回申请成功后，赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

（五）申购、赎回与转换的数额限制

1、A类份额

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

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

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

（4）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见招募说明书或相关公告；

（5）基金管理人可根据市场情况，调整申购的金额和赎回或转换的份额的数量限制，基金管理人必须在调整 3 个工作日前在中国证监会指定媒介上刊登公告；

2、H类份额

H类份额的申购赎回数额限制请见招募说明书补充文件或其他相关公告。

（六）申购、赎回与转换的数额和价格

1、申购份额、余额以及赎回金额的处理方式：

申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日该类基金份额净值为基准计算，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；

赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额净值的金额，赎回净额为赎回金额扣除相应的费用的金额，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。

基金管理人另行公告各基金转换的处理方式。

2、申购费、赎回费和转换费

(1) 申购费

A类份额的申购费率如下：

申购金额（元）	申购费率
申购金额<50万	1.5%
50万≤申购金额<100万	1.2%
100万≤申购金额<200万	1.0%
200万≤申购金额<500万	0.6%
申购金额≥500万	1000元/笔

在申购费按金额分档的情况下，如果投资人多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

H类份额的申购费率最高不超过5%，具体费率由各销售机构自行确定。

(2) 赎回费

A类份额：

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

A类份额的赎回费用由赎回人承担，其中对持有期少于7日的赎回费用全额计入基金财产，持有期不少于7日的赎回费用至少25%归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

H类份额：

持有期限	赎回费率
持有期<7日	1.5%
持有期≥7日	0.125%

H类份额的赎回费用由赎回人承担，赎回费100%归入基金资产。

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费率和赎回费率，调整后的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。上述费率如发生变更，基金管理人应在调整实施3个工作日前在至少一种中国证监会指定媒介上刊登公告。

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、特定职业的投资人以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购、赎回费率。

（3）转换费

基金管理人将另行公告各基金之间转换费率。

3、申购份额的计算

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

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

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

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

例 1：某投资人投资 5 万元申购本基金 A 类份额，假设申购当日 A 类份额的基金份额净值为 1.0520 元，则可得到的申购份额为：

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

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.0520 = 46826.12 \text{ 份}$$

即：投资人投资 5 万元申购本基金 A 类份额，其对应费率为 1.5%，假设申购当日 A 类份额的基金份额净值为 1.0520 元，则其可得到：46826.12 份 A 类份额。

例 2：某投资人投资 5 万元申购本基金 H 类份额，假设申购当日 H 类份额的基金份额净值为 1.0520 元，申购费率为 1.5%，则可得到的申购份额为：

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

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.0520 = 46826.12 \text{ 份}$$

即：投资人投资 5 万元申购本基金 H 类份额，假设申购当日 H 类份额的基金份额净值为 1.0520 元，申购费率为 1.5%，则其可得到：46826.12 份 H 类份额。

4、赎回净额的计算

投资人在赎回本基金时缴纳赎回费，投资人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

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

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

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

例 1：某投资人赎回本基金 1 万份 A 类份额，持有时间为一年两个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日 A 类份额的基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回净额

为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.0520 = 10520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10520 \times 0.25\% = 26.3 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 10520 - 26.3 = 10493.7 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份 A 类份额，假设赎回当日 A 类份额的基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回净额为 10493.7 元。

例 2：某投资人赎回本基金 1 万份 H 类份额，赎回费率为 0.125%，假设赎回当日 H 类份额的基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回净额为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.0520 = 10520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10520 \times 0.125\% = 13.15 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 10520 - 13.15 = 10506.85 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份 H 类份额，假设赎回当日 H 类份额的基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回净额为 10506.85 元。

5、转换份额的计算

$$\text{转出金额} = \text{转出基金份额} \times \text{转出基金 T 日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回费用} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

$$\text{转入金额} = \text{转出金额} - \text{转出基金赎回费用}$$

$$\text{转换费用} = \text{转入金额} / (1 + \text{转换费率}) \times \text{转换费率}$$

$$\text{净转入金额} = \text{转入金额} - \text{转换费用}$$

$$\text{净转入份额} = \text{净转入金额} \div \text{转入基金 T 日基金份额净值}$$

6、基金份额净值计算

T 日某一类基金份额净值 = T 日该类基金资产净值 / T 日发行在外的该类基金份额总数。

基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数，基金份额净值单位为元，计算结果保留小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（七）申购、赎回与转换的注册登记

1、投资人申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理增加权益的登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资人赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

3、基金注册与过户登记人将在 T+1 日对投资者 T 日的基金转换业务申请进行有效性确认。在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构查询基金转换的成交情况。

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

（八）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请（指基金赎回份额与转出份额之和减去基金申购份额与转入份额之和后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资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：当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请有困难，或认为兑付投资人的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资人在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。香港销售机构对持有H类份额投资者的选择权另有规定的，按其规定办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人20%以内（含20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

（4）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过招募说明书规定的方式，在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在指定媒介予以公告。

（5）发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

（6）暂停接受和延缓支付：本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认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，并应当在中国证监会指定媒介公告。

（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回和转换及延缓支付赎回款项的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （4）基金财产规模过大，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的利益的情形；
- （5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或某几笔申购；
- （6）基金互认剩余额度不足导致投资者无法申购 H 类份额的情形；
- （7）在香港销售的基金规模占基金总资产的比例高于 50%，导致投资者无法申购 H 类份额的情形；
- （8）接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；
- （9）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；
- （10）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资人的申购申请时，申购款项将退回投资人账户。发生上述第（1）、（2）、（3）、（4）、（6）、（7）、（9）、（10）项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回或转换申请或延缓支付赎回款项：

- （1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回与转换申请的情况；
- （4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或某几笔赎回或转换；
- （6）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
- （7）法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。在暂停赎回与转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回与转换业务的办理并及时公告。

3、发生基金合同、招募说明书中未予载明的的事项，但基金管理人认为有正当理由需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会必要的审核后，可以暂停接受投资人的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回与转换，基金管理人应按规定公告。

5、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告。

(1) 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人将于重新开放日，在中国证监会指定媒介，刊登基金重新开放申购、赎回与转换的公告，并公告最新的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人将提前 1 个工作日，在中国证监会指定媒介，刊登基金重新开放申购、赎回或转换的公告，并在重新开放申购、赎回或转换日公告最新的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过 2 个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购、赎回或转换时，基金管理人应提前 3 个工作日，在中国证监会指定媒介连续刊登基金重新开放申购、赎回或转换的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

(十) 定期定额投资计划

本基金为基金投资者提供定期定额投资计划服务。通过定期定额投资计划，基金投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购本基金基金份额。该定期申购计划不受最低申购份额限制，具体以基金管理人的公告为准。

(十一) 基金转换

根据相关法律法规以及本基金合同的规定，基金管理人提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则及转换费率详情请见基金管理人发布的相关公告。

(十二) 本部分约定的部分业务暂不向 H 类份额投资人开通，具体请见招募说明书补充文件的规定。

九、基金的非交易过户、转托管、冻结、质押及其他业务

(一) 基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；

“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、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

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

(三) 基金份额持有人可以办理其基金份额在不同交易账户的转托管手续。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

(四) 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，该业务的具体办理方式以注册登记机构的相关规定为准。

(五) 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。

(六) H 类份额的相关业务规则可能与 A 类份额有所不同，请见届时基金管理人发布的其他相关公告。

十、基金的投资

（一）投资目标

本基金以长期投资为基本原则。通过严格的投资纪律约束和风险管理手段，投资于具备持续突出增长能力的优秀企业，辅以特定市场状况下的大类资产配置调整，追求基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、现金、短期金融工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—95%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-70%，其中，基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资组合中突出成长 A 类、高速稳定成长 B 类和高速周期成长 C 类股票的合计投资比例不低于股票资产的 80%。

（三）投资理念

中国经济处于高速发展阶段，而其发展的不均衡性使某些行业和企业出现极高的成长性。这种成长性来自于技术的变革，来自于消费方式的变化，来自于企业管理及经营模式的转型，或者来自于政府政策的变化。本基金将致力于发掘并投资于高成长行业中的优势企业，为投资者创造超额收益。

（四）投资策略

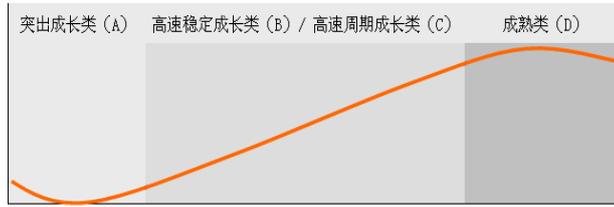
本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。

本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。

1、股票投资策略

本基金借鉴外方股东的源于企业生命周期理论的全球股票分类标准，根据企业成长的

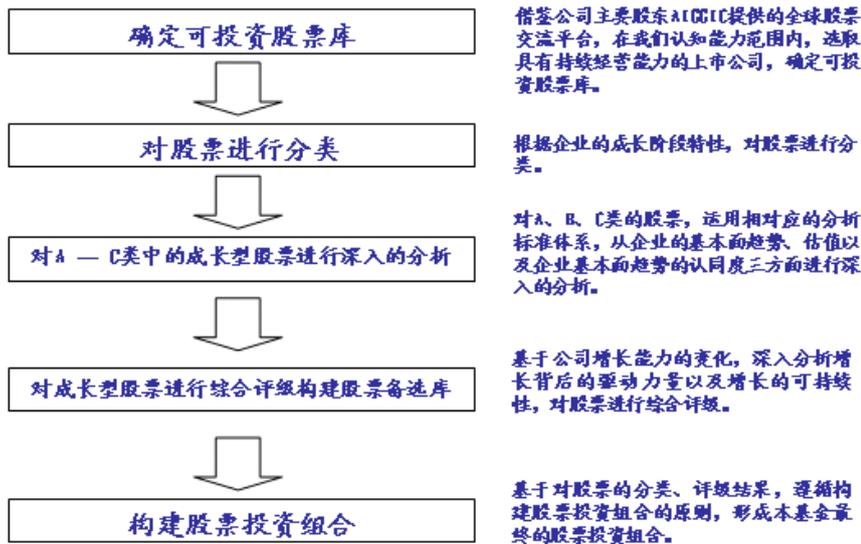
阶段特性，将股票进行分类，主要投资于其中的突出成长（A类）、高速稳定成长（B类）和高速周期成长（C类）的公司。



A、B、C三类股票的主要特征如下。

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

(1) 具体股票投资流程图如下。



本基金将重点关注 A、B、C 三类企业经营状况中出现的新变化因素，判断这些因素是否会驱动行业或企业发展趋势出现良性的变化；依据企业近期销售收入、利润、现金流和经营利润率的变化去识别增长加速的企业；同时根据各个行业的经营特征和具体指标再加以横向比较，以进一步确认行业或企业基本面的变化趋势。

(2) 增长归因分析和三元复合评级

针对出现增长加速的行业或企业，在分析增长背后的驱动力量（这些力量包括技术的变革、消费者消费方式的变化、企业管理及经营模式的转型、或者政府政策的变化）的基础上，本基金将深入分析行业的竞争状况、企业的行业地位、产品的特性和市场需求的变化等因素来判断这些驱动力量所带来的增长是否具备持续性。

本基金借鉴外方股东的三元复合投资评级体系，从企业的基本面趋势、估值以及企业

基本面趋势的认同度三方面对备选公司进行量化综合评级，按照一定的权重加总得出对该股票的综合评级。具体公式为：综合评级级别 = X×企业基本面趋势的评级级别+Y×估值的评级级别+Z×企业基本面趋势的认同度的评级级别（X、Y、Z为设定权重）。

三元复合股票综合评级是构建股票备选库的重要环节，是基金经理投资决策的依据之一。如需调整，将由公司投资决策委员会根据基金经理和投资研究团队对市场形势等因素综合判断后的建议加以调整。

（3）股票投资组合的构建原则

本基金遵循自下而上的选股原则，基于对股票的分类、评级的结果进行股票组合的构建。本基金将重点投资于 A、B、C 三类满足成长性标准的股票，分享高速稳定成长类和高速周期成长类企业的发展带来的资本增值。对于处在成熟阶段的企业，本基金将本着审慎的原则，通过准确判断其基本面改善的概率，进行适度投资。

为了避免自下而上的选股方法造成的行业集中度过高而引起的组合流动性下降的风险，以及较高的组合非系统性风险，本基金将在对行业的基本面趋势、行业整体估值水平等因素进行深入研究的基础上，对股票组合进行适当的行业分布调整。

2、大类资产配置策略

大类资产配置策略是指“基于宏观经济和证券市场运行环境的整体研究，结合内部和外部的研究支持，本基金管理人分析判断股票和债券估值的相对吸引力，从而决定各大类资产配置比例的调整方案，进行主动的仓位控制”。

本基金为混合型基金，以股票投资为主，一般情况下本基金将保持配置的基本稳定，最高可到 95%。大类资产配置策略不作为本基金的核心策略。但考虑到中国 A 股市场现阶段仍存在较大的系统性风险，本基金在某些特定的市场状况下会进行大类资产配置调整（股票投资的比例最低不低于 30%）。

本基金需要进行大类资产配置调整的特定市场状况主要指股票市场的整体估值水平严重地偏离了企业实际的盈利状况和预期的成长率，出现明显的价值高估，如果不及时调整将可能给基金持有人带来潜在的资本损失的情况。

3、债券投资策略

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，自上而下，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券和货币市场工具组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金

风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta 对冲策略等。

5、存托凭证投资策略

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

（五）投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；
- 2、投资分析团队对于宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议；
- 3、投资分析团队对于企业和债券基础分析的报告和建议；
- 4、投资风险管理团队对于投资组合风险评估的报告和建议。

（六）投资决策机制

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

2、基金经理：在投资决策委员会的授权范围内，根据基金的投资政策实施投资管理，确定具体的投资品种、数量、策略，构建优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理工作。

3、基金经理助理/投资分析员：通过内部调研和参考外部研究报告，编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告，提交基金经理，作为投资决策的依据。

（七）投资程序

1、研究部、数量化投资部和交易部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关上市公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

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

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

4、交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

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

(八) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×60%+中债国债总指数×40%

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。

本基金为混合型基金，在考虑了基金股票组合的投资标的、构建流程以及市场上各个股票指数的编制方法和历史情况后，选定被市场广泛认同的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用了市场上通用的中债国债总指数。

(九) 风险收益特征

本基金属主动管理的混合型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

(十) 投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券；
 - (2) 向他人贷款或者提供担保；
 - (3) 从事承担无限责任的投资；
 - (4) 买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
 - (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
 - (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
 - (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
 - (8) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
- 如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金不受上述规定的限制。

2、基金投资组合比例限制

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超

过该证券的 10%；

(3) 本基金不得违反本基金合同关于投资范围和投资比例的约定；

(4) 本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部股改权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金管理人管理的全部基金持有同一股改权证的比例不超过该权证的 10%；本基金投资于其它权证的有关比例限制，遵从法规或监管部门的相关规定；

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

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

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

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

(9) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(10) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，本基金不受上述规定的限制。

(十一) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准，上述第（7）、（8）项除外。法律法规另有规定的从其规定。

(十二) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

- 1、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，保护基金投资者的利益。
- 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，保护基金投资者的利益。

(十三) 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2023 年 03 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	540,838,699.42	81.48
	其中：股票	540,838,699.42	81.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	37,600,000.00	5.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	85,157,395.58	12.83
8	其他资产	209,338.67	0.03
9	合计	663,805,433.67	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,993,192.00	2.12
C	制造业	421,980,164.80	68.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	368,222.80	0.06
E	建筑业	68,735.70	0.01
F	批发和零售业	225,405.56	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,514,182.76	5.30
J	金融业	66,983,538.20	10.91
K	房地产业	5,685,120.00	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,137.60	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	540,838,699.42	88.08

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600893	航发动力	1,330,100	57,393,815.00	9.35
2	600316	洪都航空	2,000,000	51,180,000.00	8.34
3	600372	中航电子	2,408,275	42,192,978.00	6.87
4	600030	中信证券	1,351,100	27,670,528.00	4.51
5	000768	中航西飞	1,045,900	26,911,007.00	4.38
6	600862	中航高科	1,150,000	25,610,500.00	4.17
7	600456	宝钛股份	660,000	23,509,200.00	3.83
8	601377	兴业证券	3,400,960	20,813,875.20	3.39
9	000733	振华科技	230,200	20,731,812.00	3.38
10	000513	丽珠集团	542,600	20,282,388.00	3.30

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

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

报告期内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的情况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	197,029.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,308.73
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	209,338.67

11.4 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。

11.5 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的情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。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。

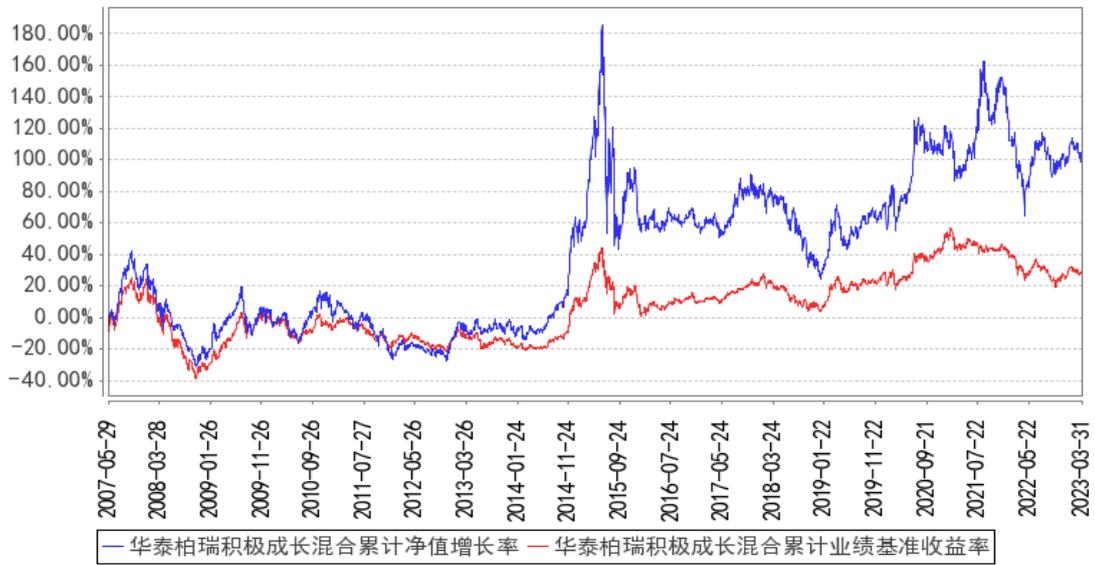
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2023 年 03 月 31 日。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007.05.29-2007.12.31	29.46%	1.45%	18.86%	1.39%	10.60%	0.06%
2008.01.01-2008.12.31	-43.14%	1.81%	-44.16%	1.83%	1.02%	-0.02%
2009.01.01-2009.12.31	43.16%	1.73%	52.60%	1.23%	-9.44%	0.50%
2010.01.01-2010.12.31	7.03%	1.40%	-5.99%	0.95%	13.02%	0.45%
2011.01.01-2011.12.31	-31.01%	1.26%	-13.97%	0.78%	-17.04%	0.48%
2012.01.01-2012.12.31	12.01%	1.18%	6.32%	0.76%	5.69%	0.42%
2013.01.01-2013.12.31	8.51%	1.18%	-3.75%	0.84%	12.26%	0.34%
2014.01.01-2014.12.31	65.34%	1.24%	31.97%	0.73%	33.37%	0.51%
2015.01.01-2015.12.31	20.73%	3.22%	6.65%	1.49%	14.08%	1.73%
2016.01.01-2016.12.31	-16.62%	1.12%	-6.84%	0.84%	-9.78%	0.28%
2017.01.01-2017.12.31	13.42%	1.05%	10.42%	0.39%	3.00%	0.66%
2018.01.01-2018.12.31	-29.23%	1.45%	-13.83%	0.80%	-15.40%	0.65%
2019.01.01-2019.12.31	33.36%	1.26%	21.15%	0.74%	12.21%	0.52%
2020.01.01-2020.12.31	24.52%	1.47%	16.09%	0.84%	8.43%	0.63%
2021.01.01-2021.12.31	17.56%	1.57%	-1.77%	0.71%	19.33%	0.86%
2023.01.01-2023.03.31	0.58%	0.77%	2.87%	0.51%	-2.29%	0.26%
自基金合同生效起至今	100.11%	1.55%	29.29%	0.99%	70.82%	0.56%

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

华泰柏瑞积极成长混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2007 年 5 月 29 日至 2023 年 3 月 31 日。

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括以各类有价证券、银行存款本息、应收款项和其他形式存在的基金资产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有财产的账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

1、基金财产由基金管理人和基金托管人严格按照法律、法规和基金合同的规定保管和处分。

2、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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

4、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

5、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金财产的估值

（一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

（二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票的估值

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

（2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如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。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

（3）有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最

近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在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。

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值：

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

5、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值信息予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（八）估值错误的处理

- 1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。
- 2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。
- 3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情形的处理

- 1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 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，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

注：根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2008]38号）等相关规定和要求，以及基金合同、招募说明书的规定，自2008年9月16日起，对旗下基金已持有的长期停牌股票，采用《中国证券业协会基金估值小组关于停牌股票估值的参考方法》中的“指数收益法”进行估值。

2008年9月16日，基金管理人发布《关于旗下基金资产估值方法调整的公告》，自2008年9月16日起，对本基金持有的长期停牌股票等没有市价的投资品种的估值将根据“中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》”规定的原则确定其公允价值，并参考《中国证券业协会基金估值小组关于停牌股票估值的参考方法》中的“指数收益法”进行估值，指数选用证券交易所公开发布的行业分类指数。

十四、基金的收益与分配

（一）收益的构成

1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3、基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

（二）收益分配原则

1、A 类份额的基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；H 类份额的基金收益分配仅采用现金方式，不设红利再投资；

2、不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

6、在符合有关基金分红条件的前提下，每类基金份额的基金收益分配每年至多 6 次；

7、各类基金份额的全年基金收益分配比例不得低于该类基金份额年度基金已实现净收益的 25%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

8、基金收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同；

9、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

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

（五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利转为基金份额。

十五、基金的费用与税收

(一) 基金运作有关的费用

1、基金运作费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- (4) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (7) 基金的资金汇划费用；
- (8) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金运作费用的计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，如降低基金管理费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施 3 个工作日前在中国证监会指定媒介公告。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、本条第 1 款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金募集过程中所发生的会计师费和律师费从基金认购费用中列支，招募说明书、发售公告等信息披露费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、托管费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金管理费率、托管费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施 3 个工作日前在中国证监会指定媒介公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、认购费

本基金认购费率按认购金额的大小分为不同档次，最高不超过 1.0%，如下表所示：

认购金额（元）	认购费率
认购金额<50 万	1.0%
50 万≤认购金额<100 万	0.8%
100 万≤认购金额< 200 万	0.6%
200 万≤认购金额< 500 万	0.4%
认购金额≥500 万	1000 元/笔

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

2、申购费

本基金的申购费用由投资人承担，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。本基金采用前端收费的形式收取申购费用。

A 类份额的申购费率按申购金额的大小分为不同档次，最高不超过 1.5%，具体如下表所示：

申购金额（元）	申购费率
申购金额<50 万	1.5%
50 万≤申购金额<100 万	1.2%
100 万≤申购金额<200 万	1.0%
200 万≤申购金额<500 万	0.6%
申购金额≥500 万	1000 元/笔

H 类份额的申购费率最高不超过 5%，具体费率由各销售机构自行确定。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据市场情况制定促销计划，在基金促销活

动期间，基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金申购费率。

3、赎回费

本基金 A 类份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对持有期少于 7 日的赎回费用全额计入基金财产，持有期不少于 7 日的赎回费用不低于 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。赎回费率随投资人持有本基金的时间的增加而递减，投资人持有本基金 7 日以内的，赎回费率为 1.5%，投资人持有本基金 7 日到一年之间的赎回费率为 0.5%，投资人持有本基金一年到两年之间的赎回费率为 0.25%，投资人持有本基金两年以上的赎回费为零。

如下表所示：

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

H 类份额持有本基金 7 日以内的赎回费率为 1.5%，投资人持有本基金 7 日及以上的赎回费率为 0.125%。H 类份额的赎回费用由赎回人承担，赎回费 100% 归入基金资产。

持有期限	赎回费率
持有期<7 日	1.5%
持有期≥7 日	0.125%

4、转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担，基金转换费率由基金管理人另行公告。

5、投资人通过网上交易方式办理基金申购或转换，适用网上交易费率，详见基金管理人网站的具体规定。

6、基金管理人与基金托管人协商一致后，可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒介公告。调整后的上述费率还将在最新的更新的招募说明书中列示。

7、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、特定职业的投资人以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交一的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。

（三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金资产中列支。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照中国、中国香港及投资人所在国家法律、法规的规定履行纳税义务。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

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

（二）基金年度审计

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

十七、基金的信息披露

（一）披露原则

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

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

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

但 H 类份额的信息披露人应予披露的基金信息的披露方式详见招募说明书补充文件。

（二）基金募集信息披露

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

基金合同生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

2、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4、基金净值信息

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

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

值。

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

（三）定期报告

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

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

（四）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基

- 金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
 - 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
 - 8、基金募集期延长或提前结束募集；
 - 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
 - 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
 - 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
 - 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
 - 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
 - 14、基金收益分配事项；
 - 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
 - 16、某类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值 0.5%；
 - 17、基金开始办理申购、赎回；
 - 18、基金发生巨额赎回并延期办理；
 - 19、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
 - 20、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
 - 21、基金份额持有人大会的决议；
 - 22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
 - 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（五）清算报告

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

（六）公开澄清

在基金合同期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价

格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

(七) 信息披露文件的存放与查阅

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

在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

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

(九) 本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准。

十八、基金的风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合风险、管理风险、投资合规性风险和其它风险。

（一）投资组合风险

投资组合风险主要包括系统性风险、非系统性风险以及流动性风险。

1、系统性风险

证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动，从而导致基金收益水平变化，使本基金资产面临的风险。

主要包括：

1) 政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险；

2) 经济周期风险：经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之发生变化，从而产生风险；

3) 利率风险：金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险；

4) 购买力风险：基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

2、非系统性风险

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

3、流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致基金不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金是契约型开放式基金，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

（二）管理风险

基金的管理风险主要包括两个方面：一是在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。另一方面，基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

基金的管理风险包括以下几种具体风险：

（1）交易风险

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

（2）系统故障风险

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

（3）交易结算风险

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

（4）会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误,通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中,由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失,从而对基金收益造成影响的风险。

（三）投资合规性风险

投资合规性风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而可能引起法律制裁、重大财务损失或者声誉损失的风险，主要合规性风险包括如下具体风险：

（1）法律风险

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

（2）道德风险

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

（四）基金投资科创板风险

基金资产投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：

1、退市风险

- （1）科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；
- （2）退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；
- （3）执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；
- （4）不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

2、市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术产业和战略新兴产业，大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，股票投资市场风险加大。

科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

3、流动性风险

科创板投资门槛较高，科创板的投资者可能以机构投资者为主，整体流动性可能相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，基金存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

4、系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

5、政策风险

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

（五）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造

成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（六）其它风险

基金面临的其它风险包括因战争、自然灾害等不可抗力导致基金管理人、基金代销机构等无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

十九、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同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。

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

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

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

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

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

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

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

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

3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十、基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务

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

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

3、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；

- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记人办理基金注册登记业务并获取基金合同规定的费用；
- (10) 依据基金合同及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 在符合有关法律、法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整除托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (13) 依照法律、法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (14) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

4、基金管理人的义务

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，办理基金备案手续；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册, 根据托管协议的约定向基金托管人提供基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

5、基金托管人的权利

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) 自本合同生效之日起, 依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为, 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) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户, 用于证券交易资金清算;

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户, 负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;

(7) 提议召开基金份额持有人大会;

(8) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

6、基金托管人的义务

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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 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、基金份额净值、基金份额申购、赎

回价格：

- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

1、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；

- 6) 变更基金类别;
- 7) 变更基金投资目标、范围或策略;
- 8) 变更基金份额持有人大会程序;
- 9) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项;
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- 11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人书面要求召开基金份额持有人大会;
- 12) 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) 在基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式;
- 3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

- (1) 除法律法规规定或基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集;
- (2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集;
- (3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当由基金托管人自行召集。

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

- (5) 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份

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

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

3、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 40 天，在至少一家指定媒介及基金管理人网站公告。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、方式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序；
- 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) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话。

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

4、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召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（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书委派代表出席，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书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 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止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

2) 会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证

机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 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书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

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日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问

题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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

（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 7 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。

2）通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

7、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。

8、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 日内在至少一家指定媒介及基金管理人网站上公告。

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。

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。

9、H 类份额持有人参与持有人大会

本基金的香港代表或香港销售机构可作为本基金 H 类份额的名义持有人，代 H 类份额持有人出席基金份额持有人大会，代其行使基金份额持有人大会表决权等。

（三）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同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。

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

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

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

（3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

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

3、基金财产的清算

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

（2）基金财产清算组

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

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

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

（3）清算程序

1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

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

(4) 清算费用

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

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

- 1) 支付清算费用;
- 2) 交纳所欠税款;
- 3) 清偿基金债务;
- 4) 按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例, 并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)、2)、3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

(6) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

- (7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四) 争议解决方式

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

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

二十一、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

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

法定代表人：贾波

成立时间：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；

经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。基金托管人对基金投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。主要包括以下方面：

1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金的投资范围和投资对象应符合法律法规以及基金合同的规定。基金管理人应将拟投资的股票库(包括突出成长 A 类、高速稳定成长 B 类和高速周期成长 C 类的股票)、存托凭证、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督，确保 A、B、C 三类股票的合计投资比例不低于股票资产的 80%；

2) 对基金投融资比例进行监督。监督内容包括但不限于：基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例符合法律法规规定及基金合同约定的时间要求、法律法规允许的基金投资比例调整期限等；

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

①现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

②本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

③本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

④本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；本基金管理人承诺本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险和损失；

⑤本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易

的股票合并计算；

3) 对基金投资禁止行为进行监督。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银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5) 基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金托管人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

①银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；

②银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；

③如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人的投资总监或投资总监授权的人员批准。

6) 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，基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对存款银行的名单予以更新和调整，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；

7) 对法律法规规定及基金合同约定的基金投资的其他方面进行监督。

(2) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(3) 基金托管人在上述第(1)、(2)项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、基金合同及本协议的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函进行说明并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(4) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、基金合同及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反基金合同、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

(5) 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，就基金托管人的疑义进行解释或举证，并就违法违规问题进行改

正。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。

2、基金管理人

(1) 在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(2) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、基金合同及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

(3) 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三) 基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

- (1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- (2) 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、基金合同及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- (3) 基金托管人按照规定开设基金财产的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) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

(1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3、基金的银行账户的开设和管理

(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银行账户。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，均需通过本基金的银行账户进行。

(3) 本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；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) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在符合本协议第三条第（一）款第 6 项的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

(2) 本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

6、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券

和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。

8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

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。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

(四) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值的计算和复核

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

(2) 基金管理人应每个开放日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后分别计算得出当日的该基金的各项基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

(5) 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

(6) 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人

也应承担未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于证券交易所及相关证券登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

2、基金会计核算

(1) 基金账册的建立

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

(2) 会计数据和财务指标的核对

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

(3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《基金合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上。招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次；基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点。基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报

告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

(五) 基金份额持有人名册的登记与保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册包括以下几类：

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

2、基金份额持有人名册的提供

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

3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人按应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。

基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

(六) 适用法律和争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

(七) 托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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

3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算组

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

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

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

(2) 清算程序

- 1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;
- 4) 对基金财产进行评估和变现;
- 5) 制作清算报告;
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- 8) 对基金财产进行分配。

(3) 清算费用

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

(4) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

- 1) 支付清算费用;
- 2) 交纳所欠税款;
- 3) 清偿基金债务;
- 4) 按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例, 并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)、2)、3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

(5) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

- (6) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十二、对基金份额持有人的服务

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

（一）网上开户及交易服务

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

（二）账户及信息查询服务

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

（三）账单及资讯服务

1、对账单服务

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

2、资讯服务

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

（四）客户服务中心电话及在线服务

1、电话服务

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

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

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

2、在线服务

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

(五) 投诉及建议受理服务

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

(六) 联系基金管理人

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

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

二十三、其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2022 年 06 月 18 日至 2023 年 05 月 27 日），下列公告在指定媒介披露：

公告名称	披露日期
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-05-09
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-04-29
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	2023-04-22
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2023-04-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-04-14
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-04-11
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2022 年年度报告	2023-03-31
华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	2023-03-30
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-03-22
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-03-21
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2023-02-23
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	2023-02-15
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与博时财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2023-02-08
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	2023-01-20
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2022-12-13
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-12-02
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	2022-11-24
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-11-24
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-11-10
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2022-11-03
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	2022-10-26
华泰柏瑞基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申赎旗下公募基金免除相关费用的公告	2022-10-10
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海中欧财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2022-09-28
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-09-09

华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-09-03
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2022 年中期报告	2022-08-30
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-08-24
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-08-13
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-07-22
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	2022-07-21
华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司、乾道基金销售有限公司销售机构办理相关销售业务的公告	2022-07-20
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-07-16
华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金更新的招募说明书 2022 年第 1 号	2022-07-08
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	2022-07-07

二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十五、备查文件

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

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二三年六月十七日