# 华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）

[illegible]年第[illegible]号

重要提示

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

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

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

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

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

托管人对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

一、基金名称

华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金

二、基金的类别

契约型，开放式，股票型基金。

三、投资目标

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

四、投资范围

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

本基金投资的股票占基金资产的比例不低于[illegible]，债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于[illegible]，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的[illegible]。

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

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

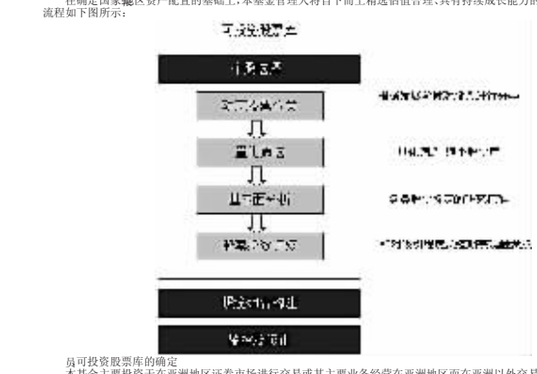
五、投资策略

国别与地区资产配置策略：

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

股票投资策略：

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



员可投资股票库的确定

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

固动态股票分类

根据企业成长阶段特性，将股票库的所有股票分为以下四个类别：突出成长、高速稳定增长、高速周期增长及成熟公司。该分类系统分析的变量包括每股收益历史增长率、每股收益[illegible]预测增长率及每股收益相关系数。该分类系统将会定期修正，然后进行确认或做出改进。该分类系统有助于确定适当的分析方法及估值标准体系。

| | 成长类别 | 主要特征 |
|---|---|---|
| 粤 | 突出成长 | 新商业模式；创新科技、创新材料。 |
| 月 | 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。 |
| 悦 | 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。 |
| 阅 | 成熟阶段 | 传统行业，技术成市场已趋于平稳和成熟。 |

猿股票的筛选及评级

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

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

源投资组合的构建及优化

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

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

缘投资组合监控

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

其它金融工具的投资策略

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

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

六、业绩比较基准

[illegible]基本综合指数（不含日本）[illegible]（[illegible]）[illegible]。

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

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

七、风险收益特征

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

八、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至[illegible]年[illegible]月[illegible]日（未经审计）。

员 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（人民币元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 员 | 权益投资 | [illegible] | [illegible] |
| | 其中：普通股 | [illegible] | [illegible] |
| | 优先股 | 原 | 原 |
| | 存托凭证 | [illegible] | [illegible] |
| | 房地产信托凭证 | 原 | 原 |
| 圆 | 基金投资 | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | 固定收益投资 | 原 | 原 |
| | 其中：债券 | 原 | 原 |
| | 资产支持证券 | 原 | 原 |
| 源 | 金融衍生品投资 | 原 | 原 |
| | 其中：远期 | 原 | 原 |
| | 期货 | 原 | 原 |
| | 期权 | 原 | 原 |
| | 权证 | 原 | 原 |
| 缘 | 买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| 远 | 货币市场工具 | 原 | 原 |
| 苑 | 银行存款和结算备付金合计 | [illegible] | [illegible] |
| 愿 | 其他资产 | [illegible] | [illegible] |
| 怨 | 合计 | [illegible] | [illegible] |

圆 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 香港交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 美国交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 新加坡交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 印尼交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 韩国交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 马来西亚交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 菲律宾交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 泰国交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 台湾亚交易所 | [illegible] | [illegible] |
| 合计 | [illegible] | [illegible] |

猿 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| [illegible]能源 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]原材料 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]工业 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]非日常生活消费品 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]日常消费品 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]医疗保健 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]金融 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]信息技术 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]电信业务 | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]公用事业 | [illegible] | [illegible] |
| 合计 | [illegible] | [illegible] |

注：本公司采用的行业分类标准为全球行业分类标准[illegible]。

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

| 序号 | 公司名称（英文） | 公司名称（中文） | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 员 | [illegible] | 凤凰卫视 | [illegible] | 香港交易所 | 中国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | [illegible] | 英皇珠宝 | [illegible] | 香港交易所 | 中国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | [illegible] | 银泰百货 | [illegible] | 香港交易所 | 中国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 源 | [illegible] | 新加坡国际生物传感器集团 | [illegible] | 新加坡交易所 | 新加坡 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 缘 | [illegible] | [illegible]服饰 | [illegible] | 香港交易所 | 中国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 远 | [illegible] | 中国神威药业 | [illegible] | 香港交易所 | 中国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | [illegible] | 港华燃气 | [illegible] | 香港交易所 | 中国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 愿 | [illegible] | [illegible]能源 | [illegible] | 泰国交易所 | 泰国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 怨 | [illegible] | 现代汽车 | [illegible] | 韩国交易所 | 韩国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| [illegible] | [illegible] | 三星电子 | [illegible] | 韩国交易所 | 韩国 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

缘 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

远 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

愿 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

怨 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 员 | [illegible] | 股票型 | 交易型开放式 | 贝莱德资产管理北亚有限公司 | [illegible] | [illegible] |

[illegible] 投资组合报告附注

[illegible]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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

[illegible]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。

猿其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|---|---|---|
| 员 | 存出保证金 | 原 |
| 圆 | 应收证券清算款 | [illegible] |
| 猿 | 应收股利 | [illegible] |
| 源 | 应收利息 | [illegible] |
| 缘 | 应收申购款 | [illegible] |
| 远 | 其他应收款 | [illegible] |
| 苑 | 待摊费用 | 原 |
| 愿 | 其他 | 原 |
| 怨 | 合计 | [illegible] |

源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。

缘报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

九、基金的业绩

本基金在业绩披露中将采用全球投资表现标准（[illegible]）的[illegible]。

员在业绩表述中采用统一的货币；

圆按照[illegible]的相关规定和标准进行计算；

猿如果[illegible]的标准与国内现行要求不符时，同时公布不同标准下的计算结果，并说明其差异；

源对外披露时，需要注明业绩计算标准是符合[illegible]要求的。

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

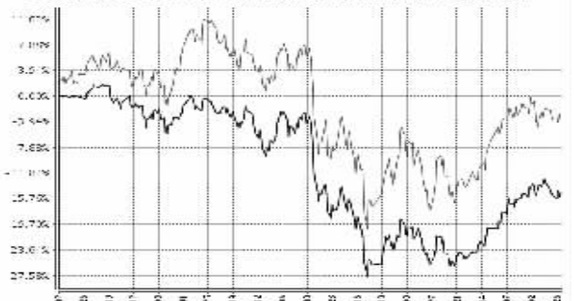
员 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

| 阶段 | 净值增长率（%） | 净值增长率标准差（%） | 业绩比较基准收益率（%） | 业绩比较基准收益率标准差（%） | 超额收益（%） | 于[illegible]（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 基金合同生效日至[illegible]年底 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| [illegible]年 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 过去三个月 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 基金合同生效日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

圆 基金的收益分配情况

| 期间 | 每[illegible]基金份额分红数 | 备注 |
|---|---|---|
| 成立至今 | 原 | 原 |
| 合计 | 原 | 原 |

猿 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




注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起记[illegible]月内为建仓期。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围中基金投资组合比例限制中规定的各项比例，股票占基金资产的比例不低于[illegible]，债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例不高于[illegible]，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的[illegible]。本基金不低于[illegible]的权益类资产将投资于亚洲领导企业。

十、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：上海浦东新区民生路[illegible]弄上海证大五道口广场[illegible]楼[illegible]

法定代表人：齐亮

成立日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]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【[illegible]】[illegible]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：沈炜

联系电话：[illegible]

股权结构：华泰证券股份有限公司[illegible]%，[illegible]%，[illegible]%，柏瑞投资有限责任公司[illegible]%，苏州新区高新技术产业股份有限公司[illegible]%。

（二）主要人员情况

员董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，[illegible]年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，[illegible]年任中央财经领导小组办公室副局长，[illegible]年至[illegible]年任华泰证券股份有限公司副总裁。

李应如女士：董事，[illegible]，曾就职于辽宁省投资公司、华光国际运输公司、君宜投资（上海）有限公司，[illegible]年任美林证券投资经理，[illegible]年任美林证券投资经理[illegible]年任加州公共雇员退休基金（[illegible]）投资经理，[illegible]年至[illegible]年任中国投资公司董事总经理，[illegible]年起兼任中国证[illegible]型投资基金[illegible]，[illegible]年起至今任柏瑞投资公司董事总经理。

吴祖芳先生：董事，硕士，[illegible]年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

[illegible]先生：董事，学士，[illegible]年加入美国国际集团，[illegible]年担任柏瑞投资（欧洲分公司）总经理，新兴市场投资主管，全球固定收益研究团队主管和行政总裁（欧洲分公司），[illegible]年至今担任柏瑞投资亚洲有限公司业务行政总裁（亚洲，日本除外）、总经理、新兴市场投资总管、全球固定收益研究团队主管。

朱小平先生，独立董事，硕士，[illegible]年今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生，独立董事，[illegible]年今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生，独立董事，博士，[illegible]年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，[illegible]年任长城证券有限公司投资银行部副总经理，[illegible]年任亚洲投股有限公司投资银行部总经理，[illegible]年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，[illegible]年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

圆监事会成员

常小抒先生，监事长，学士，[illegible]年任美国国际集团全球投资公司资深财务分析师，[illegible]年至今任柏瑞投资亚洲有限公司（原美国国际集团亚洲投资公司）亚洲区首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，[illegible]年任华泰证券股份有限公司资产管理部总经理，[illegible]年任华泰证券股份有限公司人事总部总经理，[illegible]年至今任华泰证券股份有限公司上海总部总经理。

柳军先生：监事，硕士，[illegible]年任上海汽车集团财务有限公司财务管理部经理，[illegible]年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，[illegible]年起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[illegible]基金经理助理。[illegible]年[illegible]月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。[illegible]年[illegible]月起担任指数投资部副总监。[illegible]年[illegible]月起兼任华泰柏瑞上证中小盘[illegible]基金、华泰柏瑞上证中小盘[illegible]联接基金基金经理。[illegible]年[illegible]月起兼任华泰柏瑞沪深[illegible]基金、华泰柏瑞沪深[illegible]联接基金基金经理。

猿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监监督管理委员会，[illegible]年至[illegible]年[illegible]月任华安基金管理有限公司副总经理。[illegible]年[illegible]月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王渊桐先生：副总经理，硕士，[illegible]年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，[illegible]年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，[illegible]年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，[illegible]年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

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

源本基金基金经理

李文杰先生，香港中文大学工商管理学士，特许金融分析师（[illegible]），具有[illegible]年以上证券（基金）从业经验。[illegible]年[illegible]月[illegible]年，先后担任香港[illegible]（[illegible]）[illegible]现为柏瑞投资亚洲有限公司）交易员、资深投资分析员等职位；[illegible]年加入华泰柏瑞基金管理有限公司，[illegible]年[illegible]月[illegible]年[illegible]，任华泰柏瑞（原友邦华泰）盛世中国股票型证券投资基金基金经理；[illegible]年[illegible]月[illegible]年，任阿拉伯联合酋长国阿布扎比投资局组合经理。[illegible]年[illegible]月再次加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任海外投资部总监。[illegible]年[illegible]月起任华泰柏瑞亚洲领导企业股票基金基金经理。

黄明仁先生，美国西雅图华盛顿大学金融投资硕士，具有[illegible]以上境外证券投资管理经验。[illegible]年[illegible]月[illegible]年[illegible]月，任台湾建弘投资信托股份有限公司建弘泛太平洋基金基金经理；[illegible]年[illegible]月[illegible]年[illegible]月，任英国保诚投资信托股份有限公司保诚印度基金基金经理，该基金获得各类[illegible]财杂志[illegible]年度最佳基金奖；[illegible]年[illegible]月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任海外投资部副总监。[illegible]年[illegible]月起任华泰柏瑞亚洲领导企业股票基金基金经理。

缘投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王渊桐先生；投资部总监汪晖先生；海外投资部总监李文杰先生；研究部副总监蔡静女士；基金经理沈涛先生。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

[illegible]依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

[illegible]办理基金备案手续；

[illegible]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；

[illegible]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；

[illegible]进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

[illegible]编制中期和年度基金报告；

[illegible]计算并公告基金资产净值、确定基金份额申购、赎回价格；

[illegible]办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

[illegible]召集基金份额持有人大会；

[illegible]存有基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

[illegible]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；

[illegible]中国证监会规定的其他职责。

四）基金管理人的承诺

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

[illegible]基金管理人不从事违反（基金法）的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

[illegible] 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；

[illegible] 不公平地对待其管理的不同基金财产；

[illegible] 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

[illegible] 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

[illegible] 用基金资产承销证券；

[illegible] 用基金资产向他人贷款或提供担保；

[illegible] 用基金资产从事承担无限责任的投资；

[illegible] 用基金资产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

[illegible] 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

[illegible] 以基金资产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

[illegible] 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

[illegible] 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

[illegible]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：

[illegible] 越权或违规经营；

[illegible] 违反基金合同或托管协议；

[illegible] 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

[illegible] 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

[illegible] 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

[illegible] 玩忽职守、滥用职权；

[illegible] 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

[illegible] 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他投资投资；协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

[illegible] 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

[illegible] 贬损同行，以抬高自己；

[illegible] 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

[illegible] 以不正当手段谋求业务发展；

[illegible] 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

[illegible] 法律法规禁止的其他行为。

[illegible]基金经理承诺

[illegible] 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。

[illegible] 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

[illegible] 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

[illegible] 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

员内部控制的原则

[illegible]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；

[illegible]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；

[illegible]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；

[illegible]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；

[illegible]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；

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

圆内部控制的主要内容

[illegible]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[illegible]和计划或方案。

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。

[illegible]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。

[illegible]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一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。

[illegible]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。

[illegible]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。

猿基金管理人关于内部控制的声明

[illegible]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；

圆上述关于内部控制的披露真实、准确；

猿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。

十一、基金的费用和税收

（一）基金费用的种类

员基金管理人的管理费；

圆基金托管人的托管费（[illegible]境外托管人收取的费用）；

猿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）；

源基金合同生效以后与基金相关的信息披露费用；

缘基金份额持有人大会费用；

远基金合同生效以后与基金相关的会计师费和律师费；

苑基金的资金汇划费用；

愿基金进行外汇兑换交易的费用；

怨与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；

[illegible]按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

员基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的[illegible]%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[illegible]%年费率计提。计算方法如下：

[illegible]

[illegible]为每日应计提的基金管理费

[illegible]为前一日基金资产净值

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

圆基金托管人的托管费

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

基金托管费按前一日基金资产净值的[illegible]%年费率计提。计算方法如下：

[illegible]

[illegible]为每日应计提的基金托管费

[illegible]为前一日的基金资产净值

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

猿本条第（一）款第[illegible]项第[illegible]款费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

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

（四）基金费用调整

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

（五）税收

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

十二、基金托管人

（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[illegible]号

首次注册登记日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]日

变更注册登记日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【[illegible]】[illegible]号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：[illegible]

传真：[illegible]

发展概况：

[illegible]年[illegible]月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从[illegible]年至[illegible]年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。[illegible]年，中国银行改为国有独资商业银行。[illegible]年，中国银行启动股份制改造。[illegible]年愿月，中国银行股份有限公司挂牌成立。[illegible]年远月、苑月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及[illegible]国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。[illegible]年，中国银行被[illegible]（[illegible]）评为[illegible]年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被[illegible]（[illegible]）评为[illegible]年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被[illegible]（[illegible]）评为中国最佳贸易融资银行，被[illegible]（[illegible]）评为中国最佳贸易融资银行，被[illegible]世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于[illegible]年[illegible]月设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于[illegible]年[illegible]月[illegible]日正式将基金托管部更