(上接B68版)

（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

a.现金；

b.存款证明；

c.商业票据；

d.政府债券；

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

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

（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

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

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

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

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

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

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

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

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

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

1.股票估值方法

（1）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，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市股票的估值

①送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

②首次发行且未上市的股票，按成本或估值技术确定公允价值；首次发行且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市价估值。

2、债券估值方法

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

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

3、衍生品估值方法

（1）上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

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

4、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

5、基金估值方法

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

（2）其他基金按最近公布的基金份额净值估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、汇率

人民币对主要外汇的汇率应当以中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价为准。

8、在任何情况下，基金管理人如采用本款第1~7项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第1~7项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、法律法规或监管部门有最新规定的，按其规定进行估值。

（2）基金资产净值的公告方式

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

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

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

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行，自决议生效之日起后两日内在指定媒体公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金剩余财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

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

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》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、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

七、基金财务状况

（一）基金上市前重要财务事项

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（二）基金资产负债表

本基金2015年4月3日资产负债表如下：

项目 \ 时间	2015年4月3日	年 月 日	年 月 日
资 产：			
银行存款	245,942,195.53		
结算备付金	–		
存出保证金	–		
交易性金融资产	124,223,438.90		
其中：股票投资	124,223,438.90		
基金投资	–		
债券投资	–		
资产支持证券投资	–		
衍生金融资产	–		
买入返售金融资产	–		
应收股利	437,365.43		
应收利息	6,749.06		
应收申购款	989,423,350.73		
应收证券清算款	–		
其他资产	–		
资产总计	1,360,033,099.65		
短期借款	–		
交易性金融负债	–		
衍生金融负债	–		
卖出回购金融资产款	–		
应付证券清算款	–		
应付赎回款	2,793,947.77		
应付赎回费	9,414.13		
应付管理人报酬	156,785.09		
应付托管费	32,663.56		
其他负债	170,351.33		
负债合计	3,163,161.88		
所有者权益：	1,356,869,937.77		
实收基金	1,222,648,341.60		
未分配利润	134,221,596.2		
所有者权益合计	1,356,869,937.77		
负债和所有者权益总计	1,360,033,099.65		
基金份额净值	母基金份额净值：	1.106	
	A份额净值：	1.014	
	B份额净值：	1.198	

验资报告文号	安永华明(2014)验字第60466941_B03号	出具单位	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	募集资金到帐时间	2014-3-6
基金管理费计提办法	管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率计提				
基金托管费计提办法	托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提				

八、基金投资组合

截止到2015年4月3日，本基金的投资组合如下：

（一）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	124,223,438.90	9.13
	其中：股票	124,223,438.90	9.13
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	245,942,195.53	18.08
6	其他各项资产	989,867,465.22	72.78
7	合计	1,360,033,099.65	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

板块代码	板块名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
001 能源	能源	18,832,426.26	1.39%
003 工业	工业	12,326,251.70	0.91%
004 非必需消费品	非必需消费品	7,408,054.32	0.55%
005 必需消费品	必需消费品	7,318,683.76	0.54%
007 金融	金融	19,370,280.60	1.42%
008 信息技术	信息技术	26,771,916.44	1.97%
009 电信服务	电信服务	20,833,609.68	1.54%
010 公共事业	公共事业	11,362,216.14	0.84%

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	5 HK	HSBC Holdings plc	248,000	13,148,406.96	0.97
2	700 HK	Tencent Holdings Limited	105,000	12,446,514.99	0.92
3	941 HK	China Mobile Limited	11,4000	9,273,520.15	0.68
4	1299 HK	AIA Group Limited	225,200	8,794,318.64	0.65
5	939 HK	China Construction Bank Corporation	1,573,000	8,165,432.93	0.60
6	1398 HK	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1,379,000	6,383,616.47	0.47
7	3988 HK	Bank of China Limited	1,485,000	5,428,940.52	0.40
8	2628 HK	China Life Insurance Company Limited	139,000	3,844,223.55	0.28
9	2318 HK	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	48,500	3,574,960.54	0.26
10	13 HK	Hutchison Whampoa Limited	40,000	3,440,615.88	0.25

（四）按券种分类的债券投资组合

本基金至2015年4月3日未持有债券。

（五）按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金至2015年4月3日未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1、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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	437,365.43
4	应收利息	6,749.06
5	应收申购款	989,423,350.73
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	989,867,465.22

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2014年4月3日，本基金未持有债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

九、重大事件揭示

本基金以下信息披露事项已通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人的公司网站(www.99fund.com)进行公开披露，并已报送相关监管部门备案。

序号	公告标题	披露媒体	公告日期
1	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-21
2	汇添富恒生指数分级证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-21
3	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-21
4	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-21
5	汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-21
6	汇添富恒生指数分级证券投资基金上网发售提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-24
7	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金增加招商银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-01-25
8	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金增加东海证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-02-18
9	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金增加恒泰证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-02-25
10	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-03-07
11	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-02
12	汇添富恒生指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-03
13	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金参加部分销售机构定投基金、电子渠道申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-03
14	汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生A、恒生B基金份额上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-08
15	汇添富基金管理股份有限公司关于客服中心变更办公地址的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014-04-10
16	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告_	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-11
17	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生A、恒生B基金份额上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-11
18	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年4月18日、4月21日因境外市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-16
19	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-21
20	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年5月6日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-04-30
21	汇添富基金管理股份有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014-06-10
22	汇添富基金汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-06-11
23	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年7月1日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-06-27
24	汇添富基金管理股份有限公司关于香港子公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014-07-01
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下QDII基金2014年上半年度资产净值的公告	管理人网站	2014-07-01
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华龙证券开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-07-07
27	汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-07-19
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华龙证券开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-07-24
29	汇添富基金管理有限公司澄清公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014-08-29
30	汇添富基金管理股份有限公司澄清公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2014-09-03
31	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金更新招募说明书摘要(2014年第1号)	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-10-20
32	汇添富恒生指数分级证券投资基金基金更新招募说明书(2014年第1号)	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-10-20
33	汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-10-24
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加天风证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-10-30
35	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年12月24日、25日、26日因境外市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-12-22
36	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期折算业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-12-29
37	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-12-29
38	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加同花顺为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-12-30
39	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华福证券开展的基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2014-12-31
40	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下QDII基金2014年年度资产净值的公告	管理人网站	2015-01-05
41	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金之恒生A份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-06
42	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间恒生A份额停复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-06
43	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-07
44	关于恒生A份额定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-07
45	汇添富基金管理股份有限公司关于设立上海虹桥机场分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-10
46	汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-22
47	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与湘财证券开展的网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-23
48	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与华宝证券开展的网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-01-26
49	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与数米基金开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-03-09
50	汇添富基金管理股份有限公司关于开展现金宝用户销售活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-10
51	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券开展的网上交易系统申购基金购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-03-11
52	汇添富基金管理股份有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-31
53	汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-03-31
54	汇添富恒生指数分级证券投资基金2014年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-03-31
55	关于汇添富恒生指数分级证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-04-01
56	汇添富基金管理股份有限公司关于QDII基金份额申购采取比例确认的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站、深交所	2015-04-04

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

（一）本基金备查文件包括下列文件：

1、中国证监会核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富恒生指数分级证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富恒生指数分级证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

汇添富基金管理股份有限公司

2015年4月8日

(上接B66版)

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

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

4）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。

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

5）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的10%，但持有货币市场基金不受此限制。

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

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

8）法律法规和基金合同规定的其他限制。

基金管理人应当在基金合同生效后6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。若基金超过上述2）-7）项投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。法律法规另有规定的，从其规定。

（2）禁止行为

除中国证监会另有规定外，基金不得有下列行为：

1）购买不动产。

2）购买房地产抵押按揭。

3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。

4）购买实物商品。

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

6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。

7）参与未持有基础资产的卖空交易。

8）从事证券承销业务。

9）不公平对待不同客户或不同投资组合。

10）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

11）中国证监会禁止的其他行为。

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

（3）金融衍生品投资限制

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

1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%；

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

3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

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

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

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

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

（4）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

（5）基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

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

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

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

4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

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

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

6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

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

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

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

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

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

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

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

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债（含各项有关税收）后的金额。

本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人将在每个开放日后的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的银华H股份额净值和基金份额累计净值，以及H股A份额和H股B份额的份额净值；

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

（七）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、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

（3）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

（4）中国证监会规定的其他情况。

2、基金财产的清算

（1）基金财产清算组

1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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诉讼。

（2）基金财产清算程序

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。基金财产清算程序主要包括：

1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

3)对基金财产进行清理和确认；

4)对基金财产进行估价和变现；

5)聘请律师事务所出具法律意见书；

6)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

7)将基金财产清算结果报告中国证监会；

8)参加与基金财产有关的民事诉讼；

9)公布基金财产清算结果；

10)对基金剩余财产进行分配。

（3）清算费用

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

（4）基金财产按下列顺序清偿：

1)支付清算费用；

2)交纳所欠税款；

3)清偿基金债务；

4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款1)—3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

（6）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

（八）争议的处理和适用的法律

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议