汇添富恒生指数分级证券投资基金招募说明书

（上接B5版）

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

5 基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的10%；

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

6 基金投资本国境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的10%，但持有货币市场基金不受此限制；

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

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

9 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

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

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

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）向他人贷款或者提供担保；

3）从事证券交易；

4）购买不动产；

5）购买房地产抵押按揭；

6）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；

7）购买实物商品；

8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；

9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

10）参与未持有基础资产的卖空交易；

11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

12）直接投资与实物商品相关的衍生品；

13）购其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

14）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

15）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

16）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

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

3、金融衍生品投资限制

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

①本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%；

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

③本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

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

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

c. 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%；

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

4、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

①所有参与交易的对手方（仅商业银行除外）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赎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或处置已购入证券以满足索赔需要；

④除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

a. 现金；

b. 存款证明；

c. 商业票据；

d. 政府债券；

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

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

6 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

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

①所有参与正回购交易的对手方（仅商业银行除外）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：

①所有参与交易的对手方（仅商业银行除外）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赎方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

④除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

a. 现金；

b. 存款证明；

c. 商业票据；

d. 政府债券；

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

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

6 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

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

①所有参与正回购交易的对手方（仅商业银行除外）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：

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