

# 弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金

2XA类(累积)份额(美元)、  
2XG类(累积)份额(美元对冲)

## 基金份额发售公告

基金管理人：弘收投资管理(香港)有限公司

受托人：花旗信托有限公司

内地代理人：华宝基金管理有限公司

二〇二一年七月

## 重要提示

1. 弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金(以下简称“本基金”)为依据《香港互认基金管理暂行规定》(中国证监会公告[2015]12号)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册后在内地公开销售的香港互认基金。本基金于2021年2月24日经中国证监会证监许可[2021]558号文注册。但中国证监会对本基金的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
2. 本基金经香港证券及期货事务监察委员会(以下简称“香港证监会”)认可。尽管香港证监会给予认可,但香港证监会的认可并不等于对本基金作出推荐或认许,亦不是对本基金商业利弊或表现作出保证,也不意味着本基金适合所有投资者,或认许其适合任何特定的投资者或投资者类别。
3. 本基金的管理人为弘收投资管理(香港)有限公司(以下简称“基金管理人”),受托人为花旗信托有限公司,保管人及行政管理人为花旗银行香港分行,基金登记机构及处理代理人为Citicorp Financial Services Limited,内地代理人为华宝基金管理有限公司(以下简称“内地代理人”或“华宝基金”)。
4. 本基金为常规债券型基金,基金运作方式为开放式。
5. 本基金在内地销售的份额类别:本基金可在内地销售的基金份额类别为2X类(分派)份额(人民币)(美元风险)、2X类(累积)份额(人民币)(美元风险)、2XA类(分派)份额(美元)、2XA类(累积)份额(美元)、2XB类(分派)份额(人民币)、2XB类(累积)份额(人民币)、2XG类(分派)份额(美元对冲)及2XG类(累积)份额(美元对冲)。

本基金将于2021年7月5日在内地公开销售,届时公开销售的份额类别为2X类(累积)份额(人民币)(美元风险)及2XB类(累积)份额(人民币)。

本基金本次将于2021年7月6日在内地公开销售的类别:2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)。

本基金可在法律法规允许以及条件成熟的前提下,在履行相应程序之后,视情况在内地销售其他类别(含以上类别中暂未发售的其他类别以及未来不时新增的其他类别)的基金份额。有关具体销售安排详情,请参阅基金管理人或内地代理人的公告。

6. 本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)在内地销售的基金代码

为:

2XA类(累积)份额(美元)	968120
2XG类(累积)份额(美元对冲)	968123

7. 截至本公告发布之日, 本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的内地销售机构为华宝基金管理有限公司。如增加或调整内地销售机构, 将通过内地代理人网站予以公示。内地销售机构可能调整部分基金销售网点或销售平台, 具体网点及平台名单及开户申购事项详见内地销售机构有关公告或拨打内地销售机构客户服务电话咨询, 具体以内地销售机构规定为准。
8. 本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)在内地公开销售的开始日期为: 2021年7月6日。
9. 本基金内地销售的交易日是指内地销售机构接受办理内地投资者申购、赎回、转换等业务的日期, 具体为上海证券交易所和深圳证券交易所(合称“沪深交易所”)同时开放交易的香港营业日。
10. 本基金的内地销售对象为符合内地法律法规规定可以投资于基金的企业法人、事业法人、社会团体、其他组织或金融产品。本基金在内地暂不向任何个人投资者销售。另外, 本基金不可向未经认可发售或销售本基金份额的任何司法辖区内的任何人士(包括美国人士(定义见基金说明书))销售。
11. 内地投资者通过华宝基金申购2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的, 首次申购单笔最低金额为1,000美元, 追加申购的单笔最低金额为1,000美元; 2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的单笔最低赎回份额不得少于10份, 但若内地投资者的持有份额低于10份, 其可以且仅可以发起全部份额的赎回申请; 最低持有份额为10份。

新增内地销售机构对本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的最低申购金额、交易级差、申购限额、最低赎回份额以及最低持有量另有规定的, 以各内地销售机构的业务规定为准。

12. 内地投资者欲申购本基金, 须开立中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登”)开放式基金账户, 已经有该类账户的内地投资者不须另行开立。
13. 内地销售机构对内地投资者申购申请的受理并不代表对该申请的成功确认, 而仅代表

内地销售机构确实接收了申购申请，申购申请成功与否及其确认情况应以行政管理人及中登的确认结果为准。投资者在T日(T日为本基金在内地销售的交易日)规定时间内提交的申购申请，可在T+2日内通过内地销售机构查询申购申请的确认情况。

14. 本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。内地投资者欲了解本基金的详细情况，请阅读发布在内地代理人网站([www.fsfund.com](http://www.fsfund.com))和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)的《弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金招募说明书》<sup>1</sup>、本基金《产品资料概要》及本基金信托契约。
15. 本基金在内地应予披露的信息通过内地代理人网站([www.fsfund.com](http://www.fsfund.com))和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)进行披露，内地投资者可按照基金法律文件或相关公告约定的时间和方式查阅或复制公开披露的信息资料。除内地代理人的网站和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)外，本基金应予披露的信息也可通过符合中国证监会规定条件的其他媒介进行披露。
16. 开户、申购等事项的详细情况请向本基金的内地销售机构咨询。投资者可拨打华宝基金的客户服务电话(400-700-5588、400-820-5050、021-38924558)咨询购买事宜。
17. 本基金作为香港互认基金在内地公开销售，涉及若干特别风险，包括但不限于：
  - (1) 境外投资风险(包括市场风险、政府管制风险、政治风险、法律风险、基金的税务风险、不同于内地投资标的的风险等境外投资风险)。
  - (2) 若本基金不符合《香港互认基金管理暂行规定》的条件，包括但不限于资产规模低于2亿元人民币或等值货币，或在内地的销售规模占基金总资产的比例达到或超过50%，本基金将暂停内地的销售。由于本基金在内地的销售规模不得超过基金总资产50%的比例上限，如果百分比达到46%，内地代理人可立即停止接受投资者的申购申请。若在某个交易日接收到的申购申请可能导致超过50%的上限，内地代理人将采用公平的安排按比例分摊在该交易日递交的申购申请或拒绝申购

---

<sup>1</sup> 《弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金招募说明书》由《关于弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金在内地销售的补充说明书》及《弘收高收益波幅管理债券基金(弘收策略基金的子基金)基金说明书》组成。

本公告中的“招募说明书”即指《弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金招募说明书》，“补充说明书”即指《关于弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金在内地销售的补充说明书》，“基金说明书”即指《弘收高收益波幅管理债券基金(弘收策略基金的子基金)基金说明书》。

申请，确保不超过50%的上限限制。本基金若因香港持有人大规模净赎回，导致内地投资者持有的基金份额总净值超过本基金总资产净值的50%，基金管理人及内地代理人将立即停止本基金在内地的销售。

同时，因本基金及其他在内地销售的香港互认基金受到全面的额度限制(截至本公告发布之日，该总额度限制为3,000亿元人民币)，若在内地销售的全部香港互认基金的销售额度达到中国证监会和/或香港证监会和/或国家外汇管理局规定的额度或者不时调整的额度，本基金将暂停接受内地投资者的申购申请。

- (3) 由于内地法律法规或监管政策变更导致内地与香港基金互认机制终止，或者本基金不再满足中国证监会规定的香港互认基金条件而被中国证监会撤销注册，从而终止在内地销售的风险。
- (4) 两地销售安排差异(交易日、名义持有安排等)导致的风险。
- (5) 信托契约及基金说明书适用境外法(香港法律)的风险。
- (6) 内地销售机构、内地代理人及/或内地登记结算机构的操作风险、技术风险。
- (7) 跨境数据传输和跨境资金交收的系统风险。
- (8) 税收风险。

18. “名义持有人”是指经内地投资者委托代其持有基金份额，并获基金登记机构接纳作为基金份额持有人载于基金登记机构的基金份额持有人名册上的内地代理人或其他机构。与内地基金的直接登记安排不同，受限于香港法律及行业实践，内地投资者及其所持有的基金份额并不会被基金登记机构直接登记于基金登记机构的基金份额持有人名册上。基金登记机构仅将名义持有人代名持有的本基金的基金份额合并载于其名下。内地投资者需通过名义持有人行使信托契约等基金法律文件规定的基金份额持有人权利及履行相应的基金份额持有人义务。内地投资者在提交本基金的申购申请时，应通过书面等方式确认名义持有人安排，同意委托名义持有人代为持有基金份额，成为该等基金份额法律上的拥有者，而内地投资者是该基金份额的实益拥有人，实际享有基金份额所代表的权益。

截至本公告发布之日，本基金的内地代理人华宝基金同意作为内地投资者的名义持有

人，向内地投资者提供名义持有人服务。与名义持有相关安排参见内地代理人发布的《香港互认基金基金份额登记和名义持有安排协议》或其他与名义持有服务及安排相关的说明。内地投资者应仔细阅读与名义持有服务及安排相关的文件，并通过书面或电子或内地代理人认可的其他方式对此做出确认。

19. 基金管理人兹声明，将按《香港互认基金管理暂行规定》的规定，采取合理措施，确保香港及内地投资者获得公平的对待，包括投资者权益保护、投资者权利行使、信息披露和赔偿等。
20. 除非本公告另有规定，本公告所使用的术语与本基金招募说明书界定的术语具有相同的含义。

弘收投资管理(香港)有限公司

2021年7月2日

## 一、 本基金的基本情况

### (一) 基金名称及代码

基金名称： 弘收策略基金-弘收高收益波幅管理债券基金

基金代码：	2XA类(累积)份额(美元)	968120
	2XG类(累积)份额(美元对冲)	968123

### (二) 基金类型

本基金的基金类型为常规债券型。

### (三) 基金运作方式

开放式

### (四) 基金的投资目标、投资政策和投资限制

#### 投资目标

本基金的投资目标是通过投资低于投资级别或未获评级的高收益债务工具而获得最大限度的投资总回报，包括资本增值及利息收入。

#### 投资政策

本基金将通过主要投资(即不少于本基金资产净值的三分之二)于低于投资级别或未获评级的高收益债务工具，寻求实现其投资目标。然而，在特殊情况(如市场崩盘或重大危机)或不利市场情况下，本基金可暂时性地最多将其资产净值的100%投资于投资级别债券、短期货币市场工具、现金及/或现金等价物。

债务证券可能是企业或主权国家发行的非投资级别证券及/或未获评级的债券。“非投资级别”指被标准普尔评为BBB-以下或被穆迪评为Baa3以下或被惠誉评为BBB-以下或被其他国际公认的评级机构评为同等级别的评级(如果信用评级被国际公认的信用评级机构指定)，或BB+或以下的评级(如果信用评级被中国内地的信用评级机

构指定)。“未获评级的债券”指债券本身或其发行人并无信用评级的债券。然而，本基金投资于低于投资级别的任何单一主权发行人所发行及/或担保的债务证券不会超过其资产净值的10%。

本基金可将其资产净值的至少40%投资于债务工具，该等债务工具(i)由中国的政府及/或政府相关的机构所发行或全面担保，及/或(ii)由符合下述条件的任何司法管辖区内的上市或非上市公司所发行或全面担保：在中国注册，或于中国取得大部分收入或在中国开展重大商业性经济/运营活动。本基金投资组合可能亦包括与中国无关的发行人发行的工具。本基金投资组合意在维持高度多元化，涵盖众多行业及发行人。最佳的信用选择将基于基金管理人对中国有关信用市场的深入了解及拥有的丰富经验，并获得广泛的内部信用研究及相对价值分析的支持。

在基金管理人认为适当的情况下，本基金对于以下项目的投资将均不超过其资产净值的10%：(i)于中国银行间债券市场及/或通过香港与中国内地的债券通计划(“债券通计划”)买卖的债务证券，及(ii)“城投债”(即由地方政府融资平台(“地方政府融资平台”)发行并在中国内地的上市债券市场及中国银行间债券市场交易的债务工具)。这些地方政府融资平台是地方政府及/或其关联公司出于为公益性投资或基建项目融资而设立的独立法人机构。

为免生疑，本基金投资于中国内地市场的总额不会超过其资产净值的20%。

本基金寻求通过主动管理的投资组合令波幅低于更广泛的高收益市场，从而创造高收益回报。基金管理人运用定量与定性方法管理本基金的波幅，旨在令整体投资组合的波幅低于基金管理人的目标水平。波幅是整体构建本基金投资组合时的关键及重要指标。

在定量基础上，基金管理人每日密切监测本基金投资组合内各个别债券的波幅。此外，基金管理人基于自身对各债券的信用观点，主动调整各债券的权重，致力于确保本基金整体投资组合的加权平均波幅不会超过其为本基金事先设定的年化波幅目标。例如，假如本基金的波幅上升至接近波幅目标的水平，基金管理人可卖出某些波幅较大的债券及买入波幅较小的债券，以控制整体投资组合的波幅。

总体而言，信用风险较低的债券通常波幅较低。基金管理人用于控制投资组合波幅的定性措施包括进行自下而上的信用选择，及优先选择信用质量稳定或正在改善的

发行人。因此，基金管理人认为这能更好地控制各个别债券的违约风险及管理波幅。

在正常市场情况下，本基金可将其最多30%的资产净值投资于货币市场工具、现金及/或银行存款，以管理流动性及分散投资组合风险。

如上所述，在特殊情况或不利市场情况下，本基金可最多将其资产净值的100%投资于投资级别债券及/或现金。如投资对象为投资级别债券，基金管理人将运用相同的方法，从投资级别债务证券中优先选择波幅较低的债券。

为确保本基金实现其管理波幅的目标，基金管理人会对照若干指数及基金管理人认为与本基金有可比性而由其他基金管理人管理的同类基金，以进行定期基准检查（“基准指数”）。用于比较的该等基准指数拥有可公开核实的业绩披露信息，面向零售公众发售。在选择基准指数时，基金管理人会考虑该指数或基金是否主要投资于高收益债券及该指数的成份是否与本基金具有类似的地域集中性。

本基金可投资的债务证券包括但不限于债券及基金管理人认为合适的其他高收益债务证券。本基金亦可将不超过30%的资产净值投资于中国内地以外发行的人民币计价债券及存款，以及将不超过10%的资产净值投资于或有可转换债券。除或有可转换债券外，本基金不会投资于任何其他具有吸收亏损特点的工具。由于本基金的基础货币是人民币，基金管理人可不时将非人民币投资全面或部分对冲为人民币。

本基金亦可将其不超过10%的资产净值投资于资产支持证券及投资基金。

本基金受限于基金说明书主文部分中的“投资限制”一节所述的适用投资及借款限制。

### 使用衍生工具

本基金的衍生工具净敞口最高可达其资产净值的50%。

## **(五) 基金份额在内地开始销售首日的价格**

2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)于内地发售首日将按以下价格发行：

类别	发售首日每份额申购价 <sup>2</sup> (不包括申购费)
2XA类(累积)份额(美元)	100.0000美元
2XG类(累积)份额(美元对冲)	100.0000美元

此后的申购、赎回申请，均按照申请日的基金份额净值办理。

## (六) 本基金须持续缴付的费用

以下费用将从本基金的基金财产中支付：

类型	年费率(占基金资产净值百分比)
管理费*	每年相关类别资产净值的 1.5% (根据信托契约，管理费若调整，最高水平为 2%)
受托人费用*	每年本基金资产净值的0.0075% (根据信托契约，受托人费用若调整，最高水平为 1%)， 最低年费为 10,000 美元
业绩表现费	不收取
行政管理人费用	(1) 行政管理费*： 本基金资产净值的 0 至 2.5 亿美元的部分：每年 0.1% 本基金余下部分的资产净值：每年 0.08% 最低月费为 6,000 美元 (2) 行政管理人还将有权就其在履行与本基金有关的全部及专属职责时产生的任何实付支出从本基金中获得偿付。 (3) 合规监察费： 每年为本基金资产净值的 0.01%，最低年费为 1,500 美元 (4) 财务报表编制费：每份财务报表 5,000 美元

<sup>2</sup> 如在发售首日相关份额类别并无申购，则直至该等份额类别发生第一笔申购当日，方会适用该等申购价。

<p><b>保管人费用</b></p>	<p>(1) 保管费 每年按本基金市值的最多 <b>0.075%</b>收取保管费(包括保管人就提供与债券通计划有关的保管服务,按子基金市值 <b>0.06%</b>的年率收取的保管费),最低月费为 <b>2,500</b> 美元。</p> <p>(2) 保管人有权按惯常的市场费率收取交易费及其他服务费。</p> <p>(3) 保管人将有权就其在履行职责时产生的任何实付支出从本基金中获得偿付。</p>
<p><b>基金登记机构及处理代理人费用</b></p>	<p>按惯常的市场费率收取交易费用及账户维护费用,最低月费为 <b>500</b> 美元</p>
<p><b>认可伞基金及本基金有关的费用</b></p>	<p>与获得及维持香港证监会对伞基金(即弘收策略基金)及本基金认可有关的费用预计约为 <b>150,000</b> 美元,将由本基金的所有投资者承担,于认可本基金当日起的前五个会计期间或基金管理人咨询审计师后确定的其他期间摊销。</p>
<p><b>其他收费及开支</b></p>	<p>本基金将会承担可直接归属于其的费用(包括下文所载的费用)。如果此等费用不可直接归属于本基金,则此等费用将按伞基金下的所有子基金各自资产净值所占的比例在子基金之间作出分配。</p> <p>该等费用包括但不限于投资本基金及变现本基金投资的费用(包括所有经纪、研究、融资、保证金、清算及/或买卖投资时应付的其他交易费用(如有)、借款利息及其相关费用)、保管人、基金登记机构及审计师的费用及开支、估值费用、法律费用、伞基金及本基金所认购任何责任保险的费用、基金管理人及受托人成立伞基金及本基金时发生的开支及首次发行份额或份额类别有关的费用、因编制补充契约或获得任何上市或监管批文而发生的费用、举行基金份额持有人大会及向基金份额持有人发出通知的费用、终止伞基金或本基金时发生的费用、受托人就审阅及制作与本基金的运营有关的文件(包括提交周年申报和须要提交给任何相</p>

	<p>关监管机关的其他法定信息)所耗用的时间及资源而发生的费用及开支以及编制及印刷任何基金说明书所发生的费用、公布本基金的资产净值、份额净值、份额申购价及赎回价所发生的所有费用、编制、印刷及分发所有报表、账目及报告的所有费用、编制及印刷任何销售文件的开支，以及基金管理人在咨询审计师后认为因遵守任何法律或法规或任何政府或其他监管机构的指令(无论是否具有法律效力)而发生的或与修改或推出任何此等法律、法规或指令有关的其他费用或因遵守有关单位信托的任何守则而发生或与之有关的任何其他费用。</p>
--	--

\* 如管理费、受托人费用或行政管理费由现有水平上调至最高水平，应至少提前一个月向内地投资者公告。

\* 如上调本基金(或其任何份额类别)的管理费、受托人费用或行政管理费的最高水平，则应取得香港证监会的事先批准，以及经过本基金(或该份额类别)的基金份额持有人特别决议的批准。

上述关于管理费、受托人费用等费用的详情请参阅基金说明书的“费用及开支”一节及基金说明书附录一“费用及开支”一节下的相关内容。

## (七) 收益分配政策

本基金无意就2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)及进行收益分配。因此，可归属于2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的任何净收入及净变现资本收益，将反映在其资产净值中。

## (八) 名义持有及内地注册登记安排

### 1. 名义持有安排

“名义持有人”是指经内地投资者委托代其持有基金份额，并获基金登记机构接纳作为基金份额持有人载于基金登记机构的基金份额持有人名册上的内地代

理人或其他机构。与内地基金的直接登记安排不同，受限于香港法律以及行业实践，内地投资者及其所持有的基金份额并不会被基金登记机构直接登记于基金登记机构的基金份额持有人名册上。基金登记机构仅将名义持有人代名持有的本基金的基金份额合并载于其名下。内地投资者需通过名义持有人行使信托契约等基金法律文件规定的基金份额持有人权利及履行相应的基金份额持有人义务。内地投资者在提交本基金的申购申请时，应通过书面等方式确认名义持有人安排，同意委托名义持有人代为持有基金份额，成为该等基金份额法律上的拥有者，而内地投资者是该等基金份额的实益拥有人，实际享有基金份额所代表的权益。

截至本公告发布之日，本基金的内地代理人华宝基金同意作为内地投资者的名义持有人，向内地投资者提供名义持有人服务。与名义持有相关安排参见内地代理人发布的《香港互认基金基金份额登记和名义持有安排协议》或其他与名义持有服务及安排相关的说明。内地投资者应仔细阅读与名义持有服务及安排相关的文件，并通过书面或电子或内地代理人认可的其他方式对此做出确认。

## 2. 内地注册登记安排

本基金由Citicorp Financial Services Limited作为基金登记机构为本基金提供登记服务。本基金的内地代理人委托中登为内地投资者办理账户开立、基金投资的登记和托管、份额转换和过户、内地投资者名册的管理、申购和赎回的清算和交收等服务。

### (九) 内地代理人及内地销售机构

#### 1. 内地代理人

华宝基金担任本基金的内地代理人，华宝基金系一家依据中华人民共和国法律在内地注册并有效存续并已取得中国证监会核准的公开募集证券投资基金管理业务资格的基金管理公司。

内地代理人根据基金管理人的委托，代为办理以下事项：在本基金于内地公开销售前向中国证监会申请注册、本基金的信息披露、内地销售安排、与内地销售机构及基金管理人、行政管理人的数据交换和资金清算、向中国证监会提交

监管报告、通信联络、为内地投资者提供客户服务、监控、外汇管理和账户管理、税费代扣代缴等全部或部分事项。

内地代理人作为经内地投资者确认并获基金登记机构接纳的本基金在内地销售的基金份额的名义持有人，为内地投资者提供名义持有人服务。本基金于内地销售的基金份额登记于内地代理人名下，内地投资者应通过内地代理人享有、行使信托契约等基金法律文件所规定的基金份额持有人的权利、义务。

## **2. 内地销售机构**

本基金将通过内地代理人及/或通过基金管理人聘任的或内地代理人经基金管理人授权后聘任的或内地代理人与基金管理人共同聘任的其他具有基金销售业务资格的销售机构在内地公开销售。

截至本基金在内地公开销售首日，本基金确定的内地销售机构为华宝基金管理有限公司。本基金未来也可能由其他内地销售机构办理基金销售业务。内地销售机构的调整情况将通过内地代理人网站予以公示，各内地销售机构的业务规则以各内地销售机构的公告为准。

## 二、 与申购、赎回有关的重要规定

### (一) 销售对象

本基金的内地销售对象为符合内地法律法规规定可以投资于基金的企业法人、事业法人、社会团体、其他组织或金融产品。本基金在内地暂不向任何个人投资者销售。另外，本基金不可向未经认可发售或销售本基金份额的任何司法管辖区内的任何人士(包括美国人士(定义见基金说明书))销售。

### (二) 销售场所

本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的内地销售机构为华宝基金管理有限公司。如增加或调整内地销售机构，将通过内地代理人网站予以公示。内地销售机构可能调整部分基金销售网点或销售平台，具体网点或平台名单及开户申购等事项详见内地销售机构有关公告或拨打内地销售机构客户服务电话咨询，具体规定以内地销售机构说明为准。

### (三) 份额类别

本基金可以在内地销售的基金份额类别为2X类(分派)份额(人民币)(美元风险)、2X类(累积)份额(人民币)(美元风险)、2XA类(分派)份额(美元)、2XA类(累积)份额(美元)、2XB类(分派)份额(人民币)、2XB类(累积)份额(人民币)、2XG类(分派)份额(美元对冲)和2XG类(累积)份额(美元对冲)。

本基金将于2021年7月5日在内地公开销售，届时公开销售的份额类别为2X类(累积)份额(人民币)(美元风险)和2XB类(累积)份额(人民币)。

本基金本次将于2021年7月6日在内地公开销售的类别：2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)。

本基金可在法律法规允许以及条件成熟的前提下，在履行相应程序之后，视情况在内地销售其他类别(含以上类别中暂未发售的其他类别以及未来不时新增的其他类别)的基金份额。有关具体销售安排详情，请参阅基金管理人或内地代理人的公告。

**(四) 申购、赎回份额的计价货币**

本基金依其份额类别的不同采用不同的计价货币，分别以不同的计价货币进行申购和赎回。本基金本次在内地公开销售的份额类别为**2XA类(累积)份额(美元)**及**2XG类(累积)份额(美元对冲)**。上述类别的计价货币为美元，内地投资者应先行兑换所需的美元现汇后再进行申购，相应费用由内地投资者自行承担，赎回基金份额时本基金将以美元现汇支付赎回款项。

**(五) 申购与赎回的价格**

**2XA类(累积)份额(美元)**及**2XG类(累积)份额(美元对冲)**于内地发售首日将按以下价格发行：

类别	发售首日每份额申购价 <sup>3</sup> (不包括申购费)
2XA类(累积)份额(美元)	100.0000美元
2XG类(累积)份额(美元对冲)	100.0000美元

其后，**2XA类(累积)份额(美元)**及**2XG类(累积)份额(美元对冲)**于任何交易日的每份额申购价(不包括任何申购费用)和赎回价将参照该类别截至与该交易日相关的估值日的估值时间的份额净值计算。

**(六) 申购、赎回的费用**

本基金目前向内地投资者就**2XA类(累积)份额(美元)**及**2XG类(累积)份额(美元对冲)**销售时收取的申购费和赎回费的费率如下：

申购费                    1.5%

本基金调整在内地的申购费率的，最高不超过  
申购金额的5%。

<sup>3</sup> 如在发售首日相关份额类别并无申购，则直至该等份额类别发生第一笔申购当日，方会适用该等申购价。

赎回费 无

本基金调整赎回费率的，最高不得超过赎回金额的2%

内地投资者应向内地销售机构查询具体适用费率。

在遵守相关法律法规、信托契约及基金说明书相关规定的前提下，本基金可调整上述费用的费率，调整实施前将提前公告。

内地销售机构经基金管理人事先认可，可以定期或不定期开展基金促销活动，对基金销售费用实行一定的优惠。

## (七) 申购、赎回的规则

### 1. 申购、赎回的申请时间

内地投资者可在每个交易日的申请截止时间前向内地销售机构申请申购、赎回本基金。本基金在内地销售的每个交易日的申请截止时间为15:00(北京时间)或者经基金管理人认可的内地销售机构所设的其他时间。在非交易日或交易日的申请截止时间后提交的申购、赎回申请将视为下一个交易日提出的申请。

内地投资者可通过内地销售机构申请申购、赎回本基金。各内地销售机构可能有不同的交易手续，包括较早的收取申请及/或已结算资金截止时间。内地投资者应向内地销售机构查询有关交易手续详情。

内地投资者通过内地销售机构申购、赎回基金份额，基金管理人、受托人及基金登记机构将视内地投资者可以委托的并获基金登记机构接纳的内地代理人或其他机构为申请人及名义持有人，并对相关内地投资者与名义持有人之间关于申购、持有及赎回基金份额的任何安排及任何相关事宜，以及任何可能由其产生的成本或损失概不负责。

基金管理人在任何申请中可(及应受托人要求须)酌情接纳或拒绝受理全部或部分基金份额的申购申请。如果内地投资者的申购申请被拒绝，申请款项将不计利息退还至内地投资者，所涉风险及费用由内地投资者承担。

## 2. 申购份额最小单位

内地投资者申购本基金的申购份额的确认将以截位法的方式保留至小数点后2位，该等进位调整的任何相应款项将归本基金所有。若前述进位调整方式因内地登记结算机构业务规则变更而相应调整，届时将向内地投资者公告。

## 3. 申购、赎回申请的确认及款项支付

内地投资者应向内地销售机构查询有关支付申购款项及赎回款项的详情。

本基金申购和赎回遵循“金额申购、份额赎回”的原则。本基金将以交易日的申请截止时间前内地销售机构受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金的内地登记结算机构(即中登)在T+1日内对该交易的有效性进行确认，内地投资者可于T+2日(包括该日)以销售机构规定的方式查询申请的确认情况。T+n日中n为交易日。

在赎回申请的有效性经确认后，在正常情况下，赎回款项通常预计于T+6日内(但在任何情况下不得超过以下较迟者之后一个日历月：(i)有关赎回日，及(ii)处理代理人收到填妥的赎回表格及受托人、基金管理人及/或处理代理人可能要求的该等其他文件及信息当天)，由基金管理人将资金划至本基金在内地的募集资金专用账户，并预计于T+7日内由募集资金专用账户划入内地代理人开立的香港基金代销账户。赎回款项预计将于通常情况下T+8日内支付回到内地投资者的银行结算账户，具体到账时点以内地销售机构安排为准。上述因付款引起的任何银行费用将由内地投资者承担。T+n日中n为交易日。

申购款和赎回款的支付方式应采用银行转账及内地销售机构认可的方式。除此之外，基金说明书所规定的其他支付方式不适用于内地投资者。另外，本基金不接受以实物方式支付申购、赎回对价。

若本基金申购、赎回业务处理流程因内地登记结算机构调整其业务规则而相应调整或基金管理人在法律法规允许的范围内调整本基金申购、赎回业务处理流程的，将在调整前向内地投资者公告。

## 4. 巨额赎回

为保障本基金所有基金份额持有人的利益，经受托人批准，基金管理人可将在任何赎回日赎回的本基金的份额数量(无论通过出售给基金管理人还是注销份额)限制为本基金已发行份额总数的10%。在此情况下，限额将按比例分配，则在该赎回日有效申请赎回本基金的所有基金份额持有人，将按相同的比例赎回基金份额。在内地相关法律法规允许及内地登记结算机构认为可行的情况下，并未赎回(但在没有有限额的情况下本会被赎回)的任何基金份额将按照相同的限额顺延赎回，并将于下一个赎回日及其后所有赎回日(基金管理人就此具有相同权力)获优先赎回，直至原赎回申请得到全部处理为止。如按此规定顺延处理赎回申请，基金管理人将于该赎回日起7个香港营业日内通知有关内地投资者。尽管有前述安排，目前内地登记结算机构及内地代理人的技术条件仅能支持在触发前述赎回限制情形时，内地投资者的赎回申请被部分确认后，未确认的赎回申请将被拒绝，不支持顺延处理。

#### 5. 基金份额的转换

经基金管理人或内地代理人公告，在内地登记机构支持的情况下，本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)在内地的销售可以开通基金份额转换业务，允许内地投资者将其持有的本基金供内地投资者申购的2XA类(累积)份额(美元)及/或2XG类(累积)份额(美元对冲)与本基金被允许在内地销售的其他美元类别基金份额之间进行转换，或与经中国证监会注册并获准在内地销售的伞基金下的另一子基金的美元基金份额之间进行转换。

本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)开通基金份额转换业务的，届时将由基金管理人或内地代理人公告。

#### 6. 定期定额投资

本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)开通定期定额投资业务。内地投资者可通过内地销售机构提出固定日期和每期固定申购金额的定期定额投资业务申请。内地投资者申请办理定期定额投资业务成功后，内地销售机构将在每期约定扣款日为内地投资者自动完成扣款和当期申购。每期固定申购金额应不低于内地代理人或者内地销售机构在相关公告中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

开通定期定额投资业务的内地销售机构由本基金的内地代理人根据各内地销售机构的实际情况进行确定。内地投资者可在内地代理人网站查询有关于开通此业务的内地销售机构的公告，并至开通此业务的内地销售机构的营业网点及网站咨询详细的业务规则。

#### (八) 申购限额、赎回限额及最低持有量限制

1. 就基金份额持有人(名义持有人层面)而言，本基金在内地销售的2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的最低首次申购额、最低后续申购额、最低赎回量及最低持有量如下：

	最低首次申购额	最低后续申购额	最低赎回量 (适用于部分赎回)	最低持有量
2XA类(累积)份额(美元)	200美元	200美元	200美元	200美元
2XG类(累积)份额(美元对冲)	200美元	200美元	200美元	200美元

基金份额持有人可于任何交易日全部或部分赎回其持有的基金份额，如果赎回申请会导致基金份额持有人所持有的某份额类别的份额少于该份额类别的最低持有量，则基金管理人可认为该申请是就该基金份额持有人所持有的相关份额类别的所有份额而作出。

基金管理人可不时(无论在一般情况下还是特定情况下)酌情决定豁免、更改或接受低于上述最低首次/后续申购金额、最低赎回量或最低持有量的申购金额、赎回量或持有量。

2. 对内地投资者而言，本基金的2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的最低首次申购额、最低后续申购额、最低赎回量、最低持有量由内地代理人或内地销售机构设置，内地投资者应向内地代理人或内地销售机构进行查

询。

内地投资者通过华宝基金申购2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的,首次申购单笔最低金额为1,000美元,追加申购的单笔最低金额为1,000美元;2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的单笔最低赎回份额不得少于10份,但若内地投资者的持有份额低于10份,其可以且仅可以发起全部份额的赎回申请;最低持有份额为10份。

新增内地销售机构对本基金2XA类(累积)份额(美元)及2XG类(累积)份额(美元对冲)的最低申购金额、交易级差、申购限额、最低赎回份额以及最低持有量另有规定的,以各内地销售机构的业务规定为准。

## (九) 暂停申购和赎回的情形

### 1. 暂停申购

发生下列任一情况时,基金管理人可暂停接受内地投资者的申购申请:

- (1) 本基金发生基金说明书“估值及暂停”一节“暂停”分节中规定的情形;
- (2) 由于沪深交易所交易日与香港营业日有差异,基金管理人在妥善考虑本基金的投资和结算安排,以及现有基金投资者利益的情况下,可能会通过公告方式,暂停接受内地投资者的申购申请;
- (3) 本基金出现基金资产规模低于 2 亿元人民币或等值货币,或在内地的销售规模占基金总资产的比例达到或超过 50%等导致本基金不符合《香港互认基金管理暂行规定》规定的注册条件的情形时,本基金将暂停内地的销售,直至本基金重新符合香港互认基金的条件;
- (4) 当本基金在内地的销售规模达到 46%时,本基金可停止接受内地投资者的申购申请;
- (5) 本基金及其他在内地销售的香港互认基金将受到全面的额度限制。若在内地销售的全部香港互认基金的销售额度达到中国证监会和/或香港证监会和/或国家外汇管理局规定的额度或者不时调整的额度,本基金将公告暂停接

受内地投资者的申购申请。

## 2. 暂停赎回

本基金发生基金说明书“估值及暂停”一节“暂停”分节中规定的情形时，基金管理人可暂停接受内地投资者的赎回申请。

### 三、 内地销售机构业务办理程序

#### 内地销售机构情况

##### 华宝基金管理有限公司

住所： 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址： 上海市浦东新区浦电路370号宝钢大厦905室

法定代表人： XIAOYI HELEN HUANG (黄小薏)

客户服务电话： 400-700-5588、400-820-5050、021-38924558

网站： www.fsfund.com

#### 内地投资者的开户及申购具体程序

##### (一) 内地投资者通过华宝基金办理开户与申购的程序

###### 1. 开户

(1) 机构投资者提供下列资料办理基金的开户手续：

(a) 加盖公章的有统一社会信用代码的营业执照；

(b) 加盖公章的企业可依法开展经营、社会活动的证件，如年金资格；

(c) 加盖公章的银行开户许可证或开户证明；

(d) 加盖公章的法定代表人有效身份证件(包括身份证：新版身份证必须将正反面复印在同一页、军人证、武警证、护照等)；

(e) 加盖公章的授权经办人有效身份证件(包括身份证：新版身份证必须将正反面复印在同一页、军人证、武警证、护照等)；

(f) 印鉴卡一式两份；

(g) 业务授权委托书；

- (h) 电子交易协议；
  - (i) 权益须知；
  - (j) 风险测评问卷；
  - (k) 《账户业务申请表》；
  - (l) 诚信记录证明；
  - (m) 经有关金融监管部门批准设立的金融机构，需提供相关业务资格证明、批复文件；
  - (n) 机构税收居民身份声明文件；
  - (o) 控制人税收居民身份声明文件；
  - (p) 投资者基本信息表；
  - (q) 股权或者控制权的相关信息，主要包括：注册证书、存续证明文件、合伙协议、信托协议、备忘录、公司章程以及其他可以验证身份的文件；
  - (r) 股东或者董事会成员登记信息，主要包括：董事会、高级管理层和股东名单、各股东持股数量以及持股类型(包括相关的投票权类型)等；
  - (s) 如需对共性材料备案，需提供共性材料备案申请函；
  - (t) 若公章或法人章涉及授权，请同时提供授权书和所涉及的自然人身份证正复印件。
- (2) 金融机构理财产品投资者提供下列资料办理基金的开户手续：

- (a) 依据上述“机构投资者”材料要求提供其管理人的相关材料；
  - (b) 金融理财产品成立、备案的证明文件等材料；
  - (c) 投资者基本信息表；
  - (d) 《账户业务申请表》；
  - (e) 加盖公章的产品托管户开户回执或开户证明。
2. 开户同时可办理申购手续，需填妥并提交《基金认购申购申请表》。
3. 注意事项
- (1) 申购申请当日下午3:00之前，若投资者的申购资金未到华宝基金指定基金直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期(即有效申请日)以资金到账日为准。
  - (2) 以下将被认定为无效申购：
    - (a) 投资者划来资金，但逾期未办理开户手续或开户不成功的；
    - (b) 投资者划来资金，但逾期未办理申购手续的；
    - (c) 投资者划来的申购资金少于其申请的申购金额的；
    - (d) 华宝基金确认的其它无效资金或申购失败资金。
- (二) 投资者在其他内地销售机构的开户及申购程序以该等内地销售机构的规定为准。

## 各方名录

**基金管理人**

弘收投资管理(香港)有限公司  
香港鲗鱼涌  
英皇道 979 号  
太古坊  
康桥大厦  
3503-4室

**受托人**

花旗信托有限公司  
香港  
中环花园道三号  
冠君大厦50楼

**基金登记机构及处理代理人**

Citicorp Financial Services Limited  
香港九龙  
观塘  
海滨道83号  
One Bay East花旗大楼

**基金管理人的香港律师**

艾金岗波律师事务所  
香港  
中环皇后大道中15号  
置地广场  
告罗士打大厦18楼1801-08及10室

**内地代理人**

华宝基金管理有限公司  
上海市浦东新区世纪大道100号  
上海环球金融中心58层

**基金管理人的董事**

魏志华  
谢汉耀  
沈南鹏  
马晖洪

**保管人及行政管理人**

花旗银行香港分行  
香港  
中环花园道三号  
冠君大厦50楼

**审计师**

罗兵咸永道会计师事务所  
香港  
中环  
太子大厦22楼

**基金管理人的内地律师**

上海市通力律师事务所  
上海市浦东新区  
银城中路68号  
时代金融中心19楼

弘收投资管理(香港)有限公司

2021年7月2日