(上接A13版)

魏新顺先生,独立董事,大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长,天津市政府法制办经济法规处处长,天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。

张军先生,独立董事,博士。现任复旦大学经济学院教授。

贺强先生,独立董事,本科。现任中央财经大学金融学院教授。

2、监事会成员基本情况

李琦先生,监事会主席,硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记,天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部,天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理,本公司董事长。

张杰先生,监事,注册会计师、注册审计师。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理,锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长,锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理,内蒙古君正化工有限责任公司监事,乌海市君正矿业有限责任公司监事,鄂尔多斯市君正能源化工有限公司监事,乌海市神华君正实业有限责任公司监事会主席,内蒙古坤德物流股份有限公司监事,内蒙古君正天原化工有限责任公司监事,内蒙古君正互联网小额贷款有限公司董事长。

李渊女士,监事,硕士研究生。历任北京朗山律师事务所律师。现任芜湖高新投资有限公司法务总监。

韩海潮先生,监事,硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理,亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司信息技术总监。

张牡霞女士,监事,硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、本公司市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理,现任本公司互联网金融业务部总经理。

付颖女士,监事,硕士研究生。历任本公司内控合规部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司内控合规部总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生,董事,总经理,简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生,副总经理,硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理,北京富星投资管理公司投资经理,兴业证券公司债券总部研究部经理,银华基金管理有限公司机构理财部高级经理,中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月份加盟本公司,现任公司副总经理、固定收益总监、资深基金经理,分管公司固定收益投资业务。

周晓明先生,副总经理,硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理,万通企业集团总裁助理,中工信托有限公司投资部副总,国信证券北京投资银行一部经理,北京证券投资银行部副总,嘉实基金市场部副总监、渠道部总监,香港汇富集团高级副总裁,工银瑞信基金市场部副总监,嘉实基金产品和营销总监,盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司,同月被任命为公司首席市场官,现任公司副总经理。

熊军先生,副总经理,财政学博士。历任中央教育科学研究所助理研究员,国家国有资产管理局主任科员、副处长,财政部干部教育中心副处长,全国社保基金理事会副处长、处长、副主任、巡视员。2017年3月加盟本公司,任命为公司首席经济学家,现任公司副总经理,分管智能投资研究部及养老金业务。

童建林先生,督察长,大学本科,高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理,亚洲证券有限责任公司官昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管,华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管。2006年8月加盟本公司,历任基金会计、内控合规部副总经理、内控合规部总经理。现任本公司督察长。

4、本金投资决策委员会成员

张子法先生,北京大学软件工程硕士学位,17年证券从业经验。历任建设银行聊城市分行任金融软件项目科员,北京中联集团金融软件项目经理,上海华腾软件系统公司金融项目经理,华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司,历任高级数据工程师、基金经理助理、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证100指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年9月)、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金基金经理(2017年4月至2018年10月)、天弘量化驱动股票型证券投资基金基金经理(2018年1月至2019年8月)。现任天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生:本公司副总经理,投资决策委员会联席主席、固定收益总监。

熊军先生:本公司副总经理,投资决策委员会联席主席、公司首席经济学家。

邓强先生:首席风控官。

姜晓丽女士:固定收益机构投资部副总经理,基金经理。

黄颖女士:智能投资部副总经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集资金,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、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,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、按照规定召集基金份额持有人大会;

10、保存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、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人遵守法律的承诺

本基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违法行为的发生。

基金管理人禁止性行为的承诺。

本基金管理人依法禁止从事以下行为:

(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)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)侵占、挪用基金财产;

(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

2、基金经理承诺

(1)依照有关法律法规和基金合同的规定,本着勤勉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、被代理人、被代表人、受雇他人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3)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,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

(4)不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五)基金管理人的风险管理与内部控制制度

1、风险管理的原则

(1)全面性原则:公司风险管理必须覆盖公司所有的部门和岗位,涵盖所有风险类型,并贯穿于所有业务流程和业务环节;

(2)独立性原则:公司根据业务需要设立保持相对独立的机构、部门和岗位,并在相关部门建立防火墙;公司设立独立的风险管理部门及审计部门,负责识别、监测、评估和报告公司风险管理状况,并进行独立汇报;

(3)审慎性原则:风险管理核心是有效防范各种风险,任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

(4)有效性原则:风险管理制度具有高度权威性,是所有员工必须严格遵守的行动指南;执行风险管理制度不得有任何例外,任何员工不得拥有超越制度或违反制度的权力;

(5)适时性原则:公司应当根据公司经营战略方针等内部环境和法规、市场环境等外部环境变化及时对风险进行识别和评估,并对其管理政策和措施进行相应的调整;

(6)定量与定性相结合的原则:针对各风险、操作风险、市场风险、信用风险和流动性风险的不同特点,利用定性和定量的评估方法,建立完备的风险控制指标体系,使风险控制更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对风险管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,内控合规部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:

(1)董事会:负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理,从而控制公司的整体运营风险;

(2)督察长:独立行使督察权利,直接对董事会负责,及时向审计与风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告;

(3)投资决策委员会:负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略;

(4)风险管理委员会:拟定公司风险管理战略,经董事会批准后组织实施;组织实施董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具;根据公司总体风险控制目标,制定各业务和各环节风险控制目标和要求;落实公司就重大风险管理做出的决定或决议;听取并讨论会议议题,就重大风险管理事项形成决议;拟定或批准公司风险管理制度、流程;对责任人提出处罚建议,经总经理办公会讨论后执行。

(5)内控合规部:负责公司集中统一的合规管理工作,按照公司规定和督察长的安排履行合规管理职责,建立和完善合规管理及合规风险信息的监控、识别、处置、报告体系,不断提升公司整体合规意识和能力。

(6)风险管理部:通过投资交易系统的风控参数设置,保证各投资组合的投资比例合规;参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估,保证各投资组合场外交易的事中合规控制;负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制;

(7)审计部:通过运用系统化和规范化的方法,审查、评价并改善公司的业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性,以促进公司完善治理、增加价值和实现目标。

(8)业务部门:风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制制度综述

(1)风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格;不断提高经营管理水平,在风险最小化的前提下,确保基金份额持有人利益最大化;建立行之有效的风险控制机制和制度,确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整;维护公司信誉,保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险,包括政策和市场风险,管理风险和职业道德风险,分别制定严格防范措施,并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

(2)内控合规管理制度

为保障持续规范发展,公司制定合规管理制度。公司设督察长,负责公司合规管理工作,实施对公司经营管理合规合法性的审查、监督和检查。内控合规部负责公司集中统一的合规管理工作,按照公司规定和督察长的安排履行合规管理职责,建立和完善合规管理及合规风险信息的监控、识别、处置、报告体系,不断提升公司整体合规意识和能力。

(3)审计管理制度

为规范内部审计工作,公司制定内部审计管理制度。内部审计通过运用系统化和规范化的方法,审查、评价并改善公司的业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性,以促进公司完善治理、增加价值和实现目标。

(4)内部会计控制制度

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程,确保会计业务有章可循;按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督机制;为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度;为了确保基金资产的安全,公司严格规范基金清算交割工作,并在授权范围内,及时准确地完成基金清算;强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度;为了防止会计数据的毁损、散失和泄密,制定了完善的档案保管和财务交接制度。

4、风险管理和内部风险控制的措施

(1)建立、健全内控体系,完善内控制度。公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保内控合规工作是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新;

(2)建立相互分离、相互制衡的内控机制。公司建立、健全了各项制度,做到基金经理分开、投资决策分开、基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险;

(3)建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险;

(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序。公司建立了风险管理委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度做出决策;

(5)建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控;

(6)使用数量化的风险管理手段。采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示市场趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失;

(7)提供足够的培训。公司制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确,并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:国泰君安证券股份有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

办公地址:上海市静安区新闸路669号博华广场19楼

法定代表人:杨德红

成立时间:1999年8月18日

组织形式:其他股份有限公司(上市)

批准设立机关及批准设立文号:证监机构字[1999]77号

注册资本:人民币890794.7954万元整

存续期间:持续经营

基金托管业务批准文号:证监许可[2014]511号

联系人:丛艳

联系电话:021-38677336

2、发展概况

国泰君安证券前身为国泰证券和君安证券,1999年8月18日两公司合并新设为国泰君安证券股份有限公司。2015年6月26日国泰君安证券股份有限公司在上交所上市交易,证券简称为“国泰君安”,证券代码为“601211”。2017年4月11日国泰君安证券股份有限公司在香港联交所主板挂牌并上市交易,H股股票中文简称“國泰君安”,英文简称为“GTJA”,股票代码为“02611”。截至2018年12月31日,国泰君安证券直接设有6家境内子公司和1家境外子公司,并在全国设有33家分公司和420家证券营业部,是国内最早开展各类创新业务的券商之一。2008-2019年,公司连续十二年在中国证监会证券公司分类评价中被评为A类AA级,为目前证券公司获得的最高评级。截至2019年7月16日,国泰君安证券注册资本为人民币890794.7954万元整。

二、主要人员情况

杨德红先生,中国国籍,汉族,1966年出生,中共党员,工商管理硕士,现任国泰君安董事长。1989年7月起历任上海国际信托投资公司证行业务科副科长、驻德国汉堡办事处代表、投资银行二部经理,2000年7月起兼任上海上投国际投资咨询有限公司总经理;2002年9月起历任国际集团资产经营公司总经理、国际集团办公室、董事会办公室、信息中心主任,2004年2月起兼任上海国际信托投资有限公司副总经理;2005年7月起任国际集团总裁助理、国际集团资产经营公司总经理;2006年3月起任国际集团总裁助理;2008年4月起任国际集团副总裁,2009年8月起兼任上海爱建股份有限公司总经理;2014年9月起任职于国泰君安,2014年11月起任国泰君安总裁;2015年5月起任国泰君安董事长、总裁;2015年8月起任国泰君安董事长。

陈忠义先生,中国国籍,无境外居留权,1970年10月出生,经济学学士,中级经济师,现任国泰君安证券资产托管部总经理。1993年参加工作,曾任职于君安证券清算部总经理助理、国泰君安证券营运中心副总经理、光大证券营运管理总部总经理等职。“全国金融五一劳动奖章”、“上海市五一劳动奖章”“金融服务能手”称号获得者,中国证券业协会托管结算专业委员会副主任委员,带领团队设计的“直通式证券清算质量管理国际化标准平台”,被评为上海市2011年度金融创新奖二等奖。2014年2月起任国泰君安证券资产托管部总经理。

国泰君安证券总部设资产托管部,现有员工全部具备基金从业资格及本科以上学历,管理人员及业务骨干均具有多年基金、证券和银行的从业经验,从业人员囊括了经济师、会计师、注册会计师、律师、国际注册内控审计师等中高级专业技术职称及专业资格,专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各领域,是一支诚实勤勉、积极进取、专业分布合理,职业技能优良的资产托管从业人员队伍。

三、基金托管业务经营情况

国泰君安证券于2013年4月3日取得私募基金综合托管业务资格,于2014年5月20日取得证券投资基金托管资格,可为各类公开募集基金、非公开募集基金提供托管服务。国泰君安证券坚守“诚信专业、质量为本”的服务宗旨,通过组建经验丰富的专业团队、搭建安全高效的业务系统,为基金份额持有人提供值得信赖的托管服务。国泰君安证券获得证券投资基金托管资格以来,广泛开展了公募基金、基金专户、券商资管计划、私募基金等基金托管业务,与华夏、天弘、富国、银华、鹏华、华安、西部利得、富兰克林等多家基金公司及其子公司建立了托管合作关系。截至2019年7月31日托管与外包产品累计超万只,总规模超万亿,托管产品类型涉及公募基金、私募基金、基金专户、资产管理计划等,其中托管公募基金25只,产品类型涉及货币市场基金、债券型证券投资基金、指数型证券投资基金、混合型证券投资基金等,专业的服务和可靠的运营获得了管理人的一致认可。

四、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及公司内相关管理规定,加强内部管理,保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行,通过对各种风险的梳理、评估、监控,有效地实现对各项业务风险的监控和管理,确保业务稳健运行,保护基金份额持有人的合法权益。

(二)内部控制组织结构

国泰君安证券在董事会中内设风险控制委员会,是公司风险管理的最高决策机构;公司在经营管理层面设置风险管理委员会,对公司经营风险实行统筹管理,对风险管理重大事项进行审议与决策;风险管理部门包括专职履行风险管理职责的风险管理部、合规部、法律部、稽核审计部,以及计划财务部、信息技术部、营运中心等履行其他风险管理职责的部门。

资产托管部设置风控合规岗和稽核监控岗,负责制定本部门风险管理规章制度,分析报告部门整体风险管理状况,评估检查风险管理执行情况并提出改进建议,抓住要害环节和关键风险,协助业务运营岗位进行专项化解,监督风险薄弱环节的整改情况;同时部门设置风险评估及处置小组,由资产托管部总经理及各小组、运营中心负责人组成,负责对重大风险事项进行评估、确定风险管理违规事项的处理意见,突发事件应急管理等事项。

(三)内部控制制度及措施

根据《基金法》、《运作办法》《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规,基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度,确保基金托管业务运行的规范、安全、高效,包括《国泰君安证券资产托管业务管理暂行办法》、《国泰君安证券资产托管部内部控制与风险管理操作规程》、《国泰君安证券资产托管部稽核监操作规程》、《国泰君安证券资产托管部突发事件与危机处理规程》、《国泰君安证券资产托管部保密规程》、《国泰君安证券资产托管部资产保管操作规程》、《国泰君安证券资产托管部档案管理操作规程》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务管理制度化,技术系统完整独立,核心作业区实行封闭管理,业务分工合理,有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制;安全保管基金财产,保持基金财产的独立性;实行经营场所封闭式双门禁管理,并配备录音和录像监控系统;建立独立的托管运营系统并进行防火墙设置;实施严格的岗位冲突矩阵管理,重要岗位设置双人复核机制,建立严格有效的操作制约体系;深入进行职业道德教育,树立内控优先的理念,培养部门全体员工的风险防范和保密意识;配备专门的稽核监控岗对基金托管业务运行进行内部稽核审查,以保证基金托管业务内部控制的有效性。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(一)监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等有关法律法规的规定及《基金合同》约定,制定投资监督标准与监督流程,对基金合同生效之后所委托资产的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督,及时提示管理人违规风险,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对基金资产的核算、基金资产净值的计算、对各基金费用的提取与开支情况、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

(二)监督程序

基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为,应当及时通知基金管理人予以纠正,基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。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,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

一、基金份额发售机构

基金份额发售机构详见基金份额发售公告及基金管理人发布的相关公告。

二、登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话:010-59378856

传真:010-59378907

联系人:崔巍

三、出具法律意见书的律师事务所

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

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:黎明、陈颖华

联系人:陈颖华

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

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

电话:(021)23238888

经办注册会计师:薛竞、周祎

联系人:周祎

六、基金份额的发售

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其它法律法规的有关规定募集,已于2019年7月30日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可【2019】1409号)。

二、基金类型与运作方式

基金类型为股票型基金;

运作方式:交易型开放式

存续期间:不定期

三、发售方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。

投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所,或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式,请参见基金份额发售公告。

销售机构的具体名单见基金份额发售公告,基金管理人可依据实际情况增减、变更销售机构,并另行公告。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

四、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及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。

五、认购时间

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

六、发售价格

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,认购价格为1.00元。

七、投资人的认购账户开立及使用

1、账户的开立

投资人认购本基金时需具有深圳证券账户,即在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳A股账户或深圳证券投资基金账户。已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。尚无深圳证券账户的投资人,需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。有关开设深圳证券账户的具体程序和办法,请到各开户网点详细咨询有关规定。

2、账户使用注意事项

(1)深圳证券投资基金账户只能进行基金份额的网上现金认购、网下现金认购及二级市场交易,如投资人需要参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立深圳A股账户。

(2)已购买过由天弘基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资人,其拥有的天弘基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

八、认购费用

认购费用由投资人承担,认购费率如下表所示:

认购份额(M)	认购费率
M<50万份	0.80%
50万份≤M<100万份	0.50%
M≥100万份	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用,基金管理人办理网下股票认购时,可按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构,按照不高于0.80%的标准收取一定的佣金。通过基金管理人或发售代理机构进行网下股票认购的投资者,在基金管理人或发售代理机构允许的条件下,可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用(或佣金)。

九、网上现金认购

(一)认购时间详见基金份额发售公告。

(二)认购原则与认购限额

网上现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网上现金认购的,单一账户每笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人可以多次认购,累计认购份额不设上限。

投资者在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,不可撤单,申请一经确认,认购资金即被冻结。

(三)认购金额及利息折算份额的计算

认购金额=认购份额×认购价格×(1+佣金比率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购份额×认购价格×认购份额+固定费用)

认购佣金=认购份额×认购份额×佣金比率

(或若适用固定费用的,认购佣金=固定费用)

净认购金额=认购份额×认购份额

网上现金认购款项在基金募集期前产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额=利息/认购价格。

(四)认购确认

在基金合同生效后,投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十、网下现金认购

(一)认购时间详见本基金份额发售公告

(二)认购原则与认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须为1,000份或其整数倍;投资人通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资人可以多次认购,累计认购份额不设上限。

投资者在认购本基金时,需按基金管理人的规定办理相关认购手续,并备足认购资金,认购申请提交后不得撤销。

(三)通过基金管理人办理网下现金认购的认购金额的计算

认购金额=认购份额×认购价格×(1+认购费率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购份额×认购份额+固定费用)

认购费用=认购份额×认购份额×认购费率

(或若适用固定费用的,认购费用=固定费用)

净认购金额=认购份额×认购份额

网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,网下现金认购款项利息数额以登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额=利息/认购份格

(四)通过发售代理机构办理网下现金认购的认购金额的计算:同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

(五)认购确认

在基金合同生效后,投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

(六)T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请,由基金管理人于T+1日进行有效认购款项的清算交收,将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。

十一、网下股票认购

(一)认购时间详见本基金份额发售公告

(二)认购原则与认购限额

投资者在认购本基金时,需按基金管理人和发售代理机构的规定,到基金管理人和发售代理机构网点办理认购手续,并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销,发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。

网下股票认购以单只股票股数申报,用以认购的股票必须是创业板指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请,累计申报股数不设上限。

(三)特殊情形

1、已公告的将被调出创业板指数的成份股不得用于认购本基金。

2、限制个股认购规模:基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。

3、临时拒绝个股认购:对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(四)认购份额的计算方式

投资者的认购份额=@

其中:

1、i代表投资人提交认购申请的第i只股票,n代表投资人提交的股票总只数,如投资人仅提交了1只股票的申请,则n=1。

2、“第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据深圳证券交易所的当日行情数据,以该股票的总成交金额除以总成交股数计算,以四舍五入的方法保留至小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交,则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则由于投资者获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整:

除息:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

送股:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价×(1+每股送股比例)

配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股配股比例)

送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

除息、送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

3、“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。其中:

(1)对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限的计算方式详见届时相关公告。如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限,则按照各投资人的认购申报数量同比例收取。对于基金管理人未确认的认购股票,登记机构将不办理股票的过户业务。

(2)若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行,基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

通过基金管理人或发售代理机构进行网下股票认购的投资者,在基金管理人或发售代理机构允许的条件下,投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用(或佣金)。

投资者选择以现金方式支付认购费用(或佣金),则需支付的认购费用(或佣金)按以下公式计算:

认购费用(或佣金)=认购份格×认购份额×(1+认购费率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购份格×认购份额+固定费用)

认购费用=认购份格×认购份额×认购费率

(或若适用固定费用的,认购费用=固定费用)

净认购金额=认购份格×认购份额

网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,网下现金认购款项利息数额以登记机构的记录为准。利息折算的份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额=利息/认购份格

(四)通过发售代理机构办理网下现金认购的认购金额的计算:同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

(五)认购确认

在基金合同生效后,投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

(六)T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请,由基金管理人于T+1日进行有效认购款项的清算交收,将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。

十一、网下股票认购

(一)认购时间详见本基金份额发售公告

(二)认购原则与认购限额

投资者在认购本基金时,需按基金管理人和发售代理机构的规定,到基金管理人和发售代理机构网点办理认购手续,并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销,发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。

网下股票认购以单只股票股数申报,用以认购的股票必须是创业板指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请,累计申报股数不设上限。

(三)特殊情形

1、已公告的将被调出创业板指数的成份股不得用于认购本基金。

2、限制个股认购规模:基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。

3、临时拒绝个股认购:对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(四)认购份额的计算方式

投资者的认购份额=@

其中:

1、i代表投资人提交认购申请的第i只股票,n代表投资人提交的股票总只数,如投资人仅提交了1只股票的申请,则n=1。

2、“第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据深圳证券交易所的当日行情数据,以该股票的总成交金额除以总成交股数计算,以四舍五入的方法保留至小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交,则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则由于投资者获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整:

除息:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

送股:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价×(1+每股送股比例)

配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股配股比例)

送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

除息、送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

3、“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。其中:

(1)对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限的计算方式详见届时相关公告。如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限,则按照各投资人的认购申报数量同比例收取。对于基金管理人未确认的认购股票,登记机构将不办理股票的过户业务。

(2)若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行,基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

通过基金管理人或发售代理机构进行网下股票认购的投资者,在基金管理人或发售代理机构允许的条件下,投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用(或佣金)。

投资者选择以现金方式支付认购费用(或佣金),则需支付的认购费用(或佣金)按以下公式计算:

认购费用(或佣金)=认购份