华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金招募说明书摘要(更新)

基金管理人:华泰证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

【重要提示】

1、本基金根据2017年7月10日中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1159号)准予注册,进行募集。本基金合同已于2017年12月1日正式生效。

2、基金管理人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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、收益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。

3、投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为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,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、社会等环境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、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。

5、本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

6、本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行、上市的股票)、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

7、基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

8、本基金份额发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

9、本基金募集的目标客户为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、发起资金提供方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。

10、基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

11、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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年5月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新。

第一部分基金管理人

一、基金管理人概况

名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层
法定代表人:崔春
成立时间:2014年10月16日
注册资本:26亿元
存续期间:持续经营
联系人:周维佳
联系电话:4008895597

华泰证券(上海)资产管理有限公司是经中国证监会证监许可[2014]679号文批准,由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014年10月成立时,注册资本3亿元人民币。2015年10月增加注册资本至10亿元人民币。2016年7月增加注册资本至26亿元人民币。

二、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

崔春女士,董事长,毕业于中国人民银行总行金融研究所货币银行学专业,获硕士学位。曾任中国光大国际信托投资公司证券部经理,光大证券有限公司总裁办高级经理,中国建设银行总行计划财务部副处长、金融机构部副处长,嘉实基金管理有限公司固定收益部总监,中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理,兼任中金香港资产管理有限公司董事。2015年5月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司董事长。

孟庆林先生,董事,毕业于东北财经大学工业经济专业,获学士学位。曾在徐州工程机械集团任职,1998年5月加入华泰证券,曾任徐州营业部总经理助理、徐州中山南路营业部副总经理、广州机场路营业部总经理、南京解放路营业部总经理、机构业务部总经理、上海分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司经纪及财富管理部(原经纪业务总部)总经理、职工监事,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事。

费雷先生,董事,毕业于北方交通大学财务会计专业,获学士学位。曾任南京铁路分局浦口车辆段财务科会计、江苏省农业投资公司财务部主管会计、江苏省国际信托投资公司财务部副科长、江苏省国际信托投资公司隆信置业有限公司财务部副总经理、信泰证券有限责任公司财务部副总经理。2009年9月加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

陈天翔先生,董事,毕业于武汉理工大学通信工程专业,获学士学位。曾任东方通信股份有限公司工程师、南京欣网视讯科技股份有限公司项目经理。2007年加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司网络金融部总经理。

2、基金管理人监事会成员

戴斐斐女士,监事,毕业于南京理工大学会计学专业,获学士学位。曾在南京金笔厂、中外合资南京荣华公司任职,1994年12月加入华泰证券,曾任稽查监察总部高级经理、计划财务部高级经理、独立存管部副总经理、上海管理总部财务清算中心主任、计划财务部副总经理兼清算中心主任等职务。现任华泰证券股份有限公司运营中心总经理,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事,兼任证通股份有限公司董事。

3、高级管理人员

崔春女士,董事长。(简历请参照上述董事会成员介绍)

朱前女士,副总经理(主持工作),毕业于复旦大学经济学院世界经济专业,获硕士学位。曾在东方证券有限责任公司、富通基金管理公司、海富通基金管理有限公司任职,曾任中国国际金融有限公司资产管理部机构事业部负责人、执行总经理。2015年3月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司副总经理(主持工作)。

刘玉生先生,首席风险官、合规总监、督察长,毕业于武汉大学政治经济学专业,获博士学位。曾任建设银行总行清算中心副主任科员、主任科员、副处长,中国证券登记结算有限责任公司业务发展部副总监、基金业务部主持工作副总监、总监,长安基金管理有限公司督察长。2016年4月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司首席风险官、合规总监、督察长。

席晓峰先生,副总经理,毕业于北京航空航天大学计算机应用专业,获硕士学位。曾任华夏证券研究所金融工程分析师、上投摩根基金管理有限公司风险管理部风险经理,国泰基金管理有限公司稽核监察部总监助理,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理、副总经理,兼任风险管理委员会主席。2015年1月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

毛甜,武汉大学金融工程硕士研究生,曾任中国航天工程咨询中心分析师、国信证券经济研究所金融工程部助理分析师、光大富尊投资有限公司研究员、投资经理。2017年7月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。

张璐,上海交通大学硕士研究生,曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员,2017年4月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。

5、公募权益类基金投资决策委员会成员:

主席:俞天甲(代,现任基金权益部权益投资岗)
成员:陈曦女士(代交易部负责人)
毛甜女士(华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理)
张璐先生(华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理)

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

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、自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7、依法接受基金托管人的监督;

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10、编制季度报告、中期报告和年度报告;

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13、按《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基金收益;

14、按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

23、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实施其他法律行为;

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26、建立并保存基金份额持有人名册;

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)将基金管理人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。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;

4、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;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、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、受雇人或任何第三者牟取利益;

3、不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,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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作,有效防范、规避和化解各类风险,最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,贯穿公司运营的所有环节,其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2、内部控制目标

(1)确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

(3)建立行之有效的风险控制系统,保障公司资产及客户资产的安全完整,维护公司股东的合法权益,并最大限度地保护投资人的合法权益。

(4)确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5)保证公司内部规章制度的贯彻执行,提高公司经营效益。

3、内部控制原则

(1)健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一;覆盖公司各个部门和各级岗位,渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内控制度的有效执行。

(3)独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立,公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离;公司设立合规风控部,承担内部控制监督检查职能,对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

(4)相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡;前台业务运作与后台管理支持适当分离。

(5)成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应,运用科学化的经营管理方法,以合理的成本实现内部控制目标。

4、控制环境

内部控制环境主要包括公司所有权结构、经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系,通过定期与不定期风险评估,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,发现风险来源和类型,针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案,及时防范和化解风险。

控制活动主要包括:授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。

内部控制的主要内容包括:市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

第二部分基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:彭纯
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码:200336
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.63亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2018年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第11位,连续五年跻身全球银行20强;根据2018年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第168位,较上年提升3位。

截至2019年3月31日,交通银行资产总额为人民币97,857.47亿元。2019年1–3月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币210.71亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称"托管中心")。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

彭纯先生,董事长、执行董事,高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事,2013年10月至2018年1月任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生,副董事长、执行董事、行长,高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长;2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长,其中:2015年10月至2018年6月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事,2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁;2014年7月至2016年11月任中国银行副行长,2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理;1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行,中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁,高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

(三)基金托管业务经营情况

截至2019年3月31日,交通银行共托管证券投资基金418只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定,加强内部管理,托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章,通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释,有效地实现对各项业务的风险管控,确保业务稳健运行,保护基金持有人的合法权益。

(二)内部控制原则

1、合法性原则:托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则:托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节,建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则:托管中心独立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立,对不同的受托基金资产分别设置账户,独立核算,分账管理。

4、制衡性原则:托管中心贯彻通当授权、相互制约的原则,从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则:托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制,通过行之有效的控制流程、控制措施,建立合理的内控程序,保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则:托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应,尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

(三)内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规,托管中心制定了一整套严密、完整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《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理,技术系统管理规范,业务管理制度健全,核心作业区实行封闭管理,落实各项安全隔离措施,相关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理,聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、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

交通银行作为基金托管人,根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购赎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。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为,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。交通银行有权对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的,交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有重大违规行为,有权立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

第三部分相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

名称:	华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:	中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室
办公地址:	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层
法定代表人:	崔春
电话:	(025)83387046
传真:	(025)83387074
联系人:	孙晶晶

2、非直销销售机构

1)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市江东中路228号
办公地址:江苏省南京市江东中路228号
法定代表人:周易
联系人:夏璐
客服电话:95597
网址:www.htsc.com

2)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:许梦园
客服电话:95587
网址:www.csc108.com

3)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2–6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号2–6层
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
客服电话:4008888888
网址:www.chinastock.com.cn

4)交通银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系人:王菁
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

5)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室–3491
办公地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室–3491
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
客服电话:020–89629066
网址:www.yingmi.cn

6)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
客服电话:4006411999
公司网址:www.taichengcaifu.com

7)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号903–906室
法定代表人:杨文斌
联系人:陆敏
客服电话:4007009665
公司网址:www.howbuy.com

8)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院泰康金融大厦38层
法定代表人:张冠宇
联系人:王国庄
客服电话:4008199868
公司网址:www.tdyhfund.com

9)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人:其实
联系人:何薇
客服电话:95021
网址:fund.eastmoney.com

10)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603–06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
客服电话:4000988511
网址:kenterui.jd.com/

11)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:胡学勤
联系人:程晨
客服电话:4008219031
网址:www.lufunds.com

12)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层
法定代表人:程刚
联系人:汪莹
客服电话:4008105919
网址:www.fengfd.com

13)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路Halo广场4楼
法定代表人:薛峰
联系人:龚江江
客服电话:4006788887
网址:www.zlfund.cn/

14)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
客服电话:4001666788
网址:www.66zichan.com

15)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO塔3A座19层
法定代表人:钟斐斐
联系人:王悦
客服电话:4000618518
网址:danjuanapp.com

16)奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
客服电话:4006840500
网址:www.ifastps.com.cn

17)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层
法定代表人:张跃伟
联系人:党敏
客服电话:4008202899
网址:www.erichfund.com

18)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼5层
法定代表人:冷飞
联系人:孙萌
客服电话:021–50810673
网址:www.wacai.com

19)华泰期货有限公司
注册地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层、29层04单元
办公地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层、29层04单元
法定代表人:吴祖芳
联系人:马丹
客服电话:4006280888
网址:www.htfc.com

20)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
法定代表人:陈柏青
联系人:傅强
客服电话:95188
网址:www.antfortune.com

21)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
客服电话:4006737010
网址:www.jianfortune.com

22)江苏天鼎证券投资咨询有限公司
注册地址:南京市秦淮区太平南路389号1002室
办公地址:江苏省南京市鼓楼区平安里74号
法定代表人:方有伟
联系人:黄丹昀
客服电话:025–962155
网址:www.tdtz888.com

23)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:李关洲
客服电话:4008205369
公司网址:www.jiyufund.com.cn

24)阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路360–1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京朝阳区朝外大街乙12号昆泰国际大厦1号楼12层
法定代表人:李科
联系人:杨超
客服电话:95510
网址:life.sinosig.com

25)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村e世界A座1108室
法定代表人:王伟刚
联系人:于伟
客服电话:400–619–9059
网址:www.hcjijin.com

26)深圳新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人:洪弘
联系人:文雯
客服电话:400–166–1188
网址:8.jrj.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并在管理人网站公示。

二、登记机构

名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层
法定代表人:崔春
电话:(021)68984368
传真:(021)28972120
联系人:白海燕

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
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
执行事务合伙人:邹俊
联系电话:(010)85085000
传真:(010)85185111
联系人:钱茹雯
经办注册会计师:张楠钱茹雯

第四部分 基金的简介

基金名称:华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金
基金类型:契约开放型

第五部分基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行、上市的股票)、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

三、标的指数

中证红利低波动指数

四、投资策略

本基金为采用完全复制标的指数的方法,进行被动指数化投资。按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金可投资债券。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。本基金将投资于流动性较好的国债等债券,保证基金资产流动性,提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化,结合债券定价技术,进行个券选择。

本基金可投资资产支持证券。资产支持证券投资主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑,采用自下而上的项目精选策略,以资产支持证券的优先级或次优级为投资标的,精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法,以基金管理人的内部信用风险评估为主,并结合外部信用评级机构的分析报告,最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外,鉴于资产支持证券的流动性较差,本基金更倾向于久期较短的品种,即使持有到期压力也不会太大。

本基金可投资权证。权证投资将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%,投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

(3)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(6)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资