海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

海富通基金管理有限公司

公告日期:2020年8月21日

上市日期:2020年8月26日

一、重要声明与提示

《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,海富通基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中信证券股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2020年4月28日刊登于《中国证券报》和海富通基金管理有限公司网站(www.hftfund.com)上的《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

2、基金二级市场交易简称:上证转债;扩位简称:上证可转债ETF

3、二级市场交易代码:511180。

4、基金申购赎回简称:上证转债。

4、申购赎回代码:511181。

5、2020年8月19日基金份额总额:60,259,729.00份。

6、2020年8月19日基金份额净值:10.1577元。

7、本次上市交易份额:60,259,729.00份。

8、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

9、上市交易日期:2020年8月26日。

10、基金管理人:海富通基金管理有限公司。

11、基金托管人:中信证券股份有限公司。

12、上市推荐人:中信证券股份有限公司。

13、申购赎回代办券商(以下简称“一级交易商”):海通证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司。若有新增本基金的申购、赎回代办券商,本公司将另行公告。本公司可根据情况变更申购赎回代办券商,并及时公告。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:2019年11月15日经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】2352号文准予注册。

2、基金运作方式:交易型开放式。

3、基金合同期限:不定期。

4、发售日期:本基金自2020年5月8日起至2020年7月3日止通过销售机构公开发售。其中,网下现金发售期间为2020年5月8日起至2020年7月3日,网上现金发售日期为2020年7月1日起至2020年7月3日,通过发售代理机构及基金管理人进行网下债券认购的发售期间为2020年5月8日起至2020年7月3日。

5、发售价格:1.00元人民币。

6、发售期限:网下现金发售39个交易日,网上现金发售3个交易日,网下债券认购39个交易日。

7、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债券认购3种方式。

8、发售机构

(1)直销机构

投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下债券认购。

(2)代销机构

本基金的网下现金认购的发售代理机构:海通证券股份有限公司;

网下债券认购的发售代理机构:海通证券股份有限公司。

(二)基金合同生效

海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金自2020年5月8日起向社会公开募集,截至2020年7月3日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,此次募集的有效净认购金额为人民币602,546,669.00元(含所募集债券市值),募集债券已过户至基金托管人中信证券股份有限公司和本基金以联名方式开立在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的证券账户。依照《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金合同》的有关规定,网下认购资金的银行利息50,625.00元折算成50,625.00份基金份额已分别计入各基金份额持有人的基金账户,归各基金份额持有人所有。本次募集认购资金已于2020年7月9日全额划入本基金在基金托管人中信证券股份有限公司开立的基金托管专户,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,本基金募集期间含本息共募集602,597,294.00份基金份额,有效认购户数为3,373户。其中:本基金管理人固有资金认购本基金0份,占本基金总份额的比例为0%,本基金管理人的从业人员认购本基金0份,占本基金总份额的比例为0%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金基金合同已符合生效条件。本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2020年7月13日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(三)基金份额折算

根据《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,海富通基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)确定2020年7月31日为海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。

基金份额折算方法为:折算后基金份额持有人持有的基金份额=折算前基金份额持有人持有的基金份额/10

“本基金管理人”)确定2020年7月31日为海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。

基金份额折算方法为:折算后基金份额持有人持有的基金份额=折算前基金份额持有人持有的基金份额/10

折算后的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。本基金管理人根据上述折算方法于2020年7月31日对基金份额持有人认购的基金份额进行了折算。本基金折算前基金份额总额为602,597,294.00份,折算前基金份额净值为1.0023元;根据本基金的基金份额折算方法,折算后基金份额总额为60,259,729.00份,折算后基金份额净值为10.0231元。折算后的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

本基金的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2020年8月3日进行了变更登记。基金份额持有人可以自2020年8月4日起在其上海证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理,并互相核对。

(四)基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书【2020】275号。

2、上市交易日期:2020年8月26日。

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称:上证转债;扩位简称:上证可转债ETF

5、二级市场交易代码:511180。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、基金申购赎回简称:上证转债。

7、申购赎回代码:511181。

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括:海通证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司。

8、本次上市交易份额:60,259,729.00份。

9、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至2020年8月19日,本基金份额持有人户数为3,373户,平均每户持有的基金份额为17,865.32份。

(二)持有人结构

截至2020年8月19日,本基金份额持有人结构如下:

机构投资者持有的基金份额为59,652,729.00份,占基金总份额98.99%;个人投资者持有的基金份额为607,000.00份,占基金总份额的1.01%。

(三)前十名基金份额持有人的情况:

截至2020年8月19日。

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	招商财富-青岛银行股份有限公司-招商财富-青新一号专项资产管理计划	10,001,350.00	16.60
2	海通证券股份有限公司	7,000,000.00	11.62
3	国泰君安证券股份有限公司	5,500,743.00	9.13
4	民生证券股份有限公司	5,000,675.00	8.30
5	吉祥人寿保险股份有限公司-传统产品	5,000,675.00	8.30
6	中信证券股份有限公司	5,000,000.00	8.30
7	中国银河证券股份有限公司	3,147,367.00	5.22
8	海富通固定收益型养老金产品-中国建设银行股份有限公司	2,500,337.00	4.15
9	海富通积极成长混合型养老金产品-中国建设银行股份有限公司	2,000,270.00	3.32
10	东海证券股份有限公司	2,000,270.00	3.32

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基本情况

名称:海富通基金管理有限公司

法定代表人:杨仓兵

注册资本:3亿元人民币

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

批准设立机关及设立批准文号:中国证监会证监基金字【2003】48号

统一社会信用代码:91310000710936241R

信息披露负责人:杨仓兵

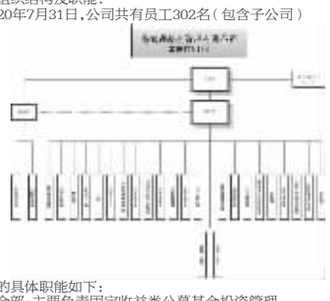
咨询电话:021-38650999

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

股权结构:海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BE控股公司49%。

2、内部组织结构及职能:

截至2020年7月31日,公司共有员工302名(包含子公司)



公司各部门的具体职能如下:

债券基金部:主要负责固定收益类公募基金投资管理。

年金专户固定收益部:主要负责养老金业务和专户业务的固定收益投资管理。

固定收益研究部:主要负责债券研究,对公司债券投资提供研究支持。

年金专户权益投资部:主要负责年金、养老金业务及专户业务的权益资产投资管理。

公募权益投资部:主要负责权益类公募基金、QDII产品、沪港深产品等境外市场的投资管理。

量化投资部:主要负责主动量化、被动指数产品的投资管理。

FOF投资部:主要负责FOF基金的投资管理。

研究部:主要负责为公司权益投资部门提供投资建议与研究支持。

交易部:主要负责根据基金经理的投资指令进行日常交易活动,对交易情况及时反馈,并对投资指令进行监督。

养老金及资产管理部:主要负责养老金业务的客户拓展和日常维护。

机构业务部:主要负责机构客户和高净值客户的公募基金业务和专户业务的拓展与维护工作。

销售支持部:主要负责公司各项业务的营销支持工作,并配合销售团队进行客户关系维护和产品研发。

零售业务部:主要负责零售业务的拓展及营销工作。

电子商务部:主要负责公司在电商业务的开拓和布局。

产品与战略发展部:主要负责制定公司公募基金产品开发和创新研究以及制定公司的战略规划。

市场营销部:主要负责公司品牌形象的建立和宣传推广。

信息技术部:主要负责公司信息系统的建设及维护。

基金会计部:主要负责公司基金资产清算,会计核算和注册登记等工作。

督察稽核部:主要负责公司的合规风险管理和内部规章制度的监督执行。

董事会监事会办公室:主要负责公司股东会、董事会、监事会及下设专业委员会的各项会议筹办、各项决议的督办及落实、协助制订公司章程、成员间联动、公司党工团建设等事务。

总经理办公室:主要负责组织公司经营管理层日常办公、总办会等重要会议、督办及落实会议决定、公司内部文化宣传、公司证照管理、日常行政及日常事务管理。

财务部:主要负责公司财务管理、编制公司财务报告以及自有资产的投资管理工作。

人力资源部:主要负责公司人力资源的开发与管理,执行公司的薪酬福利计划。

北京分公司:主要负责建立并维护与政府及证券监管部门的有效沟通和分公司的行政管理。

富诚海富通:主要负责一级市场股权投资业务、非标准化债权投资业务、资产证券化业务以及综合金融服务业务。

香港子公司:主要负责为海外客户提供投资境内证券市场QFII,RQFII投资管理、投资咨询业务。为境内客户提供投资海外证券市场投资管理、投资咨询业务。

2、基金管理业务情况简介:

从2003年8月开始,海富通先后募集成立了83只公募基金。截至2020年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模约1338亿元人民币。目前旗下正在运作的基金有海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选或号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证500指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金

海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、

海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金(LOF)、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深300指数增强型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金(FOF)、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通申乐定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、海富通中短债基金、上证5年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证5年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通30个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘6个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债3-5年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3、本基金基金经理

陈轶平先生,博士,CFA。历任Mariner Investment Group LLC数量金融分析师、瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资副总监。2013年8月至2020年7月任海富通货币基金经理。2014年8月至2019年9月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF(现为海富通上证城投债ETF)基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016年4月至2019年10月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月至2019年10月兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月至2019年10月兼任海富通瑞丰一年定开债券(现为海富通瑞丰债券)基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月至2019年10月兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。2017年3月至2019年10月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月至2019年9月兼任海富通富睿混合(现海富通沪深300指数增强)基金经理。2017年7月至2019年9月兼任海富通瑞福一年定开债券(现为海富通瑞福债券)、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019年1月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019年11月起兼任海富通上证5年期地方政府债ETF基金经理。2020年4月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020年7月起兼任海富通上证投资级可转债ETF的基金经理。

陆丛凡先生,硕士,曾任瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益定量分析师,2015年4月加入海富通基金管理有限公司,历任海富通固定收益部基金经理助理。2019年7月起任海富通上证城投债ETF、海富通上证10年期地方政府债ETF、海富通上清所短融债券的基金经理。2019年10月起兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2019年11月起兼任海富通上证5年期地方政府债ETF基金经理。2020年5月起兼任海富通中债1-3年国开债基金经理。2020年7月起兼任海富通上证投资级可转债ETF的基金经理。2020年8月起兼任海富通中债3-5年国开债基金经理。

(二)基金托管人

1、基本情况

名称:中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号

法定代表人:张佑君

成立时间:1995年10月25日

批准设立机关:国家工商总局

批准设立文号:100000000018305

组织形式:股份有限公司(上市)

注册资本:1,211,690.84万人民币

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2014]1044号

2、主要人员情况

2014年中信证券设立托管部,管理并具体承办基金托管业务。托管部下设产品管理、估值核算、托管结算、监督稽核、同业服务、渠道服务、代理清算、营销管理、跨境运营、募集监督、运营规划支持、客户服务、风险管理、基金评价、客户方案、综合等业务组。部门员工均具备证券投资基金从业资格,并具有多年金融从业经历,核心业务岗人员均已具备2年相关业务经验。截至2019年6月30日,部门员工共计110人,平均具备3年以上托管业务相关从业经验。

吴俊文女士,中信证券托管部行政负责人;西安电子科技大学计算机及应用学学士,2000年7月至2014年7月,担任中信证券清算部执行总经理,主要负责经纪业务、资产管理业务以及自营投资业务的业务运营管理工作,2014年7月起任中信证券托管部行政负责人。

(三)上市推荐人

1、名称:中信证券股份有限公司(简称:中信证券)

地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人:张佑君

客户服务电话:400-889-5548

联系人:梅家成

网址:http://www.cs.ecitic.com

(四)一级交易商

(1)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人:周杰

办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦

客户服务电话:95553或4008888001

联系人:李笑鸣

网址:www.htsec.com

(2)方正证券股份有限公司

注册地址:长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

法定代表人:施华

办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层

客户服务电话:95571

联系人:程博怡

网址:www.foundersc.com

(3)华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市江东中路228号

法定代表人:周易

办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

客户服务电话:95597

联系人:马艺卿

网址:www.htsc.com.cn

(4)申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人:杨玉成

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

客户服务电话:95523或4008895523

联系人:陈飙

网址:www.swhysc.com

(5)招商证券有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人:霍达

办公地址:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼

客户服务电话:95565

联系人:黄婵君

网址:www.newone.com.cn

(6)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

法定代表人:陈共炎

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

客户服务电话:4008888888或95551

联系人:辛国政

网址:www.chinastock.com.cn

(7)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

法定代表人:王常青

办公地址:北京市东城区朝内大街188号

客户服务电话:95587或4008888108

联系人:许梦园

网址:www.csc108.com

(8)中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人:张佑君

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

客户服务电话:95548

联系人:王一通

网址:www.cs.ecitic.com

(9)中信证券华南股份有限公司

注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人:胡伏云

办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

客户服务电话:95396

联系人:梁微

网址:www.gzs.com.cn

(10)中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人:姜晓林

办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

客户服务电话:95548

联系人:刘晓明

网址:www.zxwt.com.cn

(五)基金验资机构

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

法定代表人:李丹

经办注册会计师:薛竞、都晓燕

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:沈兆杰

(六)登记结算结构

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

注册地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话:021-58872625

传真:010-68870311

联系人:刘永卫

(七)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:陈颖华

经办律师:黎明、陈颖华

(八)审计基金财产的会计师事务所

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

法定代表人:李丹

经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:沈兆杰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件:基金合同摘要。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付,不由基金资产承担。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金截至2020年8月19日的资产负债表如下:

资产	本报告期末 2020年8月19日
资产:	
银行存款	83,880.42
结算备付金	4,914,263.57
存出保证金	221,699.89
交易性金融资产	518,852,381.30
其中:股票投资	
债券投资	518,852,381.30
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	86,000,000.00
应收证券清算款	97,207.63
应收利息	2,019,362.22
应收股利	
应收申购款	
其他资产	50,625.00
资产总计	612,239,420.03
负债和所有者权益	本报告期末 2020年8月19日
负债:	
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	
应付管理人报酬	78,826.28
应付托管费	15,765.26
应付销售服务费	
应付交易费用	
应交税费	3,304.14
应付利息	
应付利润	
其他负债	38,741.53
负债合计	136,637.21
所有者权益:	
实收基金	602,597,294.00
未分配利润	9,505,488.82
所有者权益合计	612,102,782.82
负债和所有者权益总计	612,239,420.03

注:1、截至2020年8月19日,基金份额净值10.1577元,基金份额总额60,259,729.00份。

2、本报告期自2020年7月13日起至2020年8月19日止。本基金合同于2020年7月13日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2020年8月19日,本基金的投资组合情况如下:

(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		
	其中:股票		
2	固定收益投资	518,852,381.30	84.75
	其中:债券	518,852,381.30	84.75
	资产支持证券		
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产	86,000,000.00	14.05
	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	4,998,143.99	0.82
6	其他资产	2,388,894.74	0.39
7	合计	612,239,420.03	100.00

(二)截至2020年8月19日,按行业分类的股票投资组合

无。

(三)截至2020年8月19日,按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

无。

(四)按券种分类的债券投资组合

序号	券种类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,093,409.30	0.67
2	央行票据		
3	金融债券		
	其中:政策性金融债		
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	可转债(可交换债)	514,758,972.00	84.10
7	其他		
8	合计	518,852,381.30	84.77

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110069	浦发转债	728,890	75,768,115.50	12.38
2	113011	光大转债	437,320	53,820,972.40	8.79
3	132018	G三峡EB1	291,560	33,313,645.60	5.44
4	110053	苏银转债	291,550	32,682,755.00	5.34
5	132013	17宝武EB	218,670	22,409,301.60	3.66

(六)投资组合报告附注

1、自基金合同生效日至2020年8月19日,本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下:

序号	名称	金额
1	存出保证金	221,699.89
2	应收证券清算款	97,207.63
3	应收股利	
4	应收利息	2,019,362.22
5	应收申购款	
6	其他应收款	50,625.00
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	2,388,894.74

4、权证投资情况

截至2020年8月19日,本基金未持有权证;自基金合同生效日至2020年8月19日,本基金未投资任何权证。

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110069	浦发转债	75,768,115.50	12.38
2	113011	光大转债	53,820,972.40	8.79
3	132018	G三峡EB1	33,313,645.60	5.44
4	110053	苏银转债	32,682,755.00	5.34
5	132013	17宝武EB	22,409,301.60	3.66
6	132015	18中油EB	22,128,283.20	3.62
7	132009	17中油EB	14,651,037.60	2.39
8	113013	国君转债	12,680,989.20	2.07
9	113026	核能转债	11,874,335.00	1.94
10	132020	19蓝星EB	8,652,600.00	1.41
11	113008	电气转债	7,600,569.30	1.24
12	110051	中天转债	7,144,830.00	1.17
13	113020	桐昆转债	7,190,668.80	1.17
14	110061	川投转债	7,113,601.60	1.16
15	132004	15国盛EB	6,578,249.80	1.07
16	110062	烽火转债	5,602,708.80	0.92
17	110043	无锡转债	5,166,470.40	0.84
18	110048	福能转债	5,028,015.60	0.82
19	110067	华安转债	4,980,459.00	0.81
20	113014	林洋转债	4,915,376.00	0.8
21	113024	核建转债	4,911,245.60	0.8
22	110065	海矿转债	4,754,922.90	0.78
23	110066	盛屯转债	4,654,711.60	0.76
24	110042	航电转债	4,532,463.60	0.74
25	110045	海澜转债	4,271,647.70	0.7
26	113032	桐乡转债	4,308,770.00	0.7
27	113034	震化转债	4,197,267.00	0.69
28	132021	19中电EB	4,221,725.90	0.69
29	113009	广汽转债	4,021,650.30	0.66
30	113019	玖龙转债	4,063,088.00	0.66
31	113028	环境转债	3,975,334.60	0.65
32	110031	航信转债	3,913,280.00	0.64
33	110047	山鹰转债	3,866,420.50	0.63
34	132008	17山高EB	3,781,852.80	0.62
35	113035	福莱转债	3,504,230.40	0.57
36	113508	新风转债	3,356,958.00	0.55
37	110068	龙净转债	3,247,121.10	0.53
38	132005	16国投EB	3,236,343.00	0.53
39	113543	欧派转债	3,195,972.30	0.52
40	113583	益丰转债	3,208,539.60	0.52
41	110041	蒙电转债	3,130,107.20	0.51
42	110063	鹰19转债	3,104,514.00	0.51
43	113025	明泰转债	3,116,748.60	0.51
44	113029	明阳转债	3,135,052.80	0.51
45	113033	利群转债	3,061,971.60	0.5
46	110056	亨通转债	3,021,333.90	0.49
47	132007	16凤凰EB	2,904,064.00	0.47
48	110067	现代转债	2,784,775.50	0.45
49	113545	金能转债	2,744,797.00	0.45
50	110064	建工转债	2,648,435.40	0.43
51	110052	贵广转债	2,560,936.00	0.42
52	110034	九州转债	2,539,992.00	0.41
53	113017	吉视转债	2,334,588.00	0.38
54	110060	天路转债	2,236,825.00	0.37
55	110069	瀚蓝转债	2,181,227.50	0.36
56	113534	鼎胜转债	2,145,834.00	0.35
57	110033	国贸转债	2,016,689.00	0.33
58	113031	博威转债	2,007,802.40	0.33
59	113516	苏农转债	2,040,486.70	0.33
60	113544	桃李转债	2,036,507.20	0.33
61	132014	18中化EB	2,003,445.00	0.33
62	110058	永鼎转债	1,774,514.40	0.29
63	113562	瑞泰转债	1,687,831.20	0.28
64	110065	伊力转债	1,675,297.80	0.27
65	113518	顾家转债	1,594,527.40	0.26
66	113547	宏发转债	1,492,608.80	0.24
67	113582	火炬转债	1,475,749.00	0.24
68	113563	柳药转债	1,436,056.00	0.23
69	113016	小康转债	1,275,558.60	0.21
70	113584	家悦转债	1,255,256.20	0.21
71	113504	艾华转债	1,245,496.60	0.2
72	113542	好客转债	1,217,134.10	0.2
73	113554	仙鹤转债	1,194,080.00	0.2
74	113505	杭电转债	1,192,900.80	0.19
75	110038	济川转债	1,092,328.20	0.18
76	113519	长久转债	1,122,285.50	0.18
77	113588	润达转债	1,073,980.80	0.18
78	132022	20广投EB	1,074,330.00	0.18
79	113579	健友转债	1,020,629.20	0.17
80	113530	大丰转债	981,648.50	0.16
81	113575	东时转债	907,212.60	0.15
82	113589	天创转债	892,965.80	0.15
83	113012	骆驼转债	805,589.40	0.13
84	113525	台华转债	815,730.30	0.13