华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

基金管理人:华宝基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市日期:2021年2月19日
公告日期:2021年2月9日

一、重要声明与提示

《华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)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,华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人华宝基金管理有限公司的董事会及董事保证本公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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告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”)、上海证券交易所对华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资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。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2020年12月31日发布在华宝基金管理有限公司网站(www.fsfund.com)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)上的《华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)、《华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》(以下简称“基金产品资料概要”)、《华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)。

二、基金概览

1、基金名称:华宝中证智能制造主题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:智能制造ETF。
3、二级市场交易代码:516800。
4、基金申购赎回简称:智能制造ETF。
5、申购赎回代码:516801。
6、2021年2月5日基金份额总额:855,154,000.00份。
7、2021年2月5日基金份额净值:0.9844元。
8、本次上市交易份额:855,154,000.00份。
9、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
10、上市交易日期:2021年2月19日。
11、基金管理人:华宝基金管理有限公司。
12、基金托管人:中国工商银行股份有限公司。
13、上市推荐人:平安证券股份有限公司。
14、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”):

安信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商,本公司将另行公告。

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况
1、本基金准予募集注册的机构和文号:中国证监会证监许可【2020】3460号文。
2、基金合同生效日:2021年1月29日。
3、基金运作方式:交易型开放式。
4、基金合同期限:不定期。
5、发售日期:本基金自2021年1月11至2021年1月25日进行发售。其中,网上现金认购的发售日期为2021年1月21日至2021年1月25日,通过发售代理机构进行网下现金认购和网下股票认购的发售日期为2021年1月11日至2021年1月25日。
6、发售价格:人民币1.00元。
7、发售方式:投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8、发售机构:
(1)网下现金和网下股票发售直销机构
华宝基金管理有限公司。
(2)网下现金和网下股票发售代理机构
安信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。
(3)网上现金发售代理机构
网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理,具体名单可在上海证券交易所网站查询。
9、验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。
10、募集资金总额及入账情况
本基金自2021年1月11日起公开募集,截至2021年1月25日募集工作顺利结束。

经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次募集确认的净认购金额为855,154,000.00元人民币(含所募集股票市值),折合基金份额855,154,000.00份;认购款项在募集期间产生的银行利息共计0.00元人民币,折合基金份额0.00份。本次募集认购资金已于2021年1月29日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购户数为15,382户,按照每份基金份额初始面值1.00元人民币计算,本次募集资金折合基金份额共计855,154,000.00份,已全部计入基金份额持有人的基金账户,归各基金份额持有人所有。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《华宝中证智能制造主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金募集符合有关条件,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2021年1月29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)本基金上市交易的主要内容
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[2021]53号。
2、上市交易日期:2021年2月19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:智能制造ETF。
5、二级市场交易代码:516800。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:智能制造ETF。
7、申购赎回代码:516801。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。目前本基金的一级交易商包括:安信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。
8、本次上市交易份额:855,154,000.00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2021年2月5日,本基金基金份额持有人户数为15,382户,平均每户持有的基金份额为55,594.46份。
(二)持有人结构
截至2021年2月5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37,428,000.00份,占基金总份额的4.38%;个人投资者持有的基金份额为817,726,000.00份,占基金总份额的95.62%。
(三)截至2021年2月5日,前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称(全称)	持有份额(份)	占基金总份额比例(%)
1	都邦财产保险股份有限公司-自有资金	15,000,000.00	1.75%
2	佛山市顺德区容桂华电子有限公司	10,000,000.00	1.17%
3	杨志一	5,000,000.00	0.58%
4	潘剑青	5,000,000.00	0.58%
5	杨国平	5,000,000.00	0.58%
6	宁波裁剪投资管理合伙企业(有限合伙)	5,000,000.00	0.58%
7	林华发	4,650,000.00	0.54%
8	李增强	4,590,000.00	0.54%
9	刘鹏	4,000,000.00	0.47%
10	杨碧兰	3,000,000.00	0.35%
11	王森荣	3,000,000.00	0.35%
12	李进祥	3,000,000.00	0.35%
13	刘喜堂	3,000,000.00	0.35%
14	上海保险张家港保利区投权投资基金有限公司	3,000,000.00	0.35%

五、基金主要当事人介绍

(一)基金管理人
1、公司概况
名称:华宝基金管理有限公司
法定代表人:XIAOYI HELEN HUANG(黄小蔷)
总经理:XIAOYI HELEN HUANG(黄小蔷)
注册资本:人民币15亿元
注册地址: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: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
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2003]19号
工商登记注册的法人营业执照文号:310000400034472
经营范围:发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营)
成立日期:2003年3月7日
股东名称及其出资比例:中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份,外方股东Warburg Pincus Asset Management, LP.持有49%的股份。
2、内部组织结构及职能
公司下设31个部门,包括:研究部、国内投资部、固定收益部、量化投资部、国际业务部、多元资产管理部、养老金部、资产管理业务部、机构投资部、合规审计部、风险管理部、北京分公司、深圳分公司、营销中心(西部、北方、东部、南方)、北方机构销售部、华东机构销售部、产品开发部、营销管理部、互金策划部、互金展业部、客户服务部、战略规划部、交易部、清算登记部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部。

各部门主要职责概述如下:

研究部:从事宏观经济、行业及上市公司、投资策略等方面的研究并为基金投资决策及新产品开发提供基础支持,包括宏观研究、策略研究、行业研究、金融工程研究和债券研究。

国内投资部:负责公募基金资产投资国内证券市场的日常管理和运作,在认真研究和充分论证的基础上,拟定基金投资策略和投资组合方案,经投资决策委员会批准后具体实施,并对实施过程中出现的问题进行反馈和调整。

机构投资部:负责专户资产帐户等非公募基金的投资管理业务和投资咨询业务。

国际业务部:负责公司QDII公募基金资产投资海外证券市场的日常管理和运作。

量化投资部:负责管理主动量化基金产品、开展数量化投资策略研究。

指数研发投资部:负责公司指数产品的研发和投资管理的工作。

固定收益部:主要职责是搜寻债券投资机会、并制定和实施相应的债券投资策略;进行债券分析,包括宏观经济趋势、利率政策、相对价值、信用债券;投资组合构造、优化和管理,包括风险控制、流动性管理。

多元资产管理部:负责跨资产研究;基金等资管产品研究;负责投资组织策略开发与投资交易运作;开展业务营销工作。

养老金部:负责公司社保基金、年金管理资格的申请;制定社保基金、企业年金的发展战略与规划、产品设计与创新;制定相关投资策略,开展投资管理运作;负责社保基金、企业年金的市场推广与客户开发等。

资产管理业务部:负责公募基础设施证券投资基金政策研究与业务推进,集团产融结合和高质量钢铁生态圈发展的重点工作或任务的推进落实,公司创新类业务的监管政策研究和分析等。

产品开发部:负责公司产品开发研究,在法律、法规和政策许可的条件下,根据市场需求的变化和特点,不断开发新的基金品种、拓展公司的业务范围,寻找公司新的利润增长点。

北京分公司:负责分公司的行政及后勤管理。

深圳分公司:负责维护公司在南方地区机构销售。

北方机构销售部:负责北京及周边地区机构客户的开发和维护工作。

华东机构销售部:负责上海及周边地区机构客户的开发和维护工作。

营销中心:主要负责维护公司各大区域的渠道销售。

互金展业部:负责互联网金融商务拓展;互联网金融运维统筹;互联网金融直销展业。

互金策划部:负责互联网金融产品研发;互联网金融客户资产;投顾支持;公司企宣。

营销管理部:负责公募基金销售渠道管理和维护;公募基金销售团队的考核管理;销售会务管理。

客户服务部:负责Call Center的管理和客户服务工作,协助互联网金融的网上互动服务。

战略规划部:负责公司战略发展规划及中长期发展目标的制定和实施、协助管理层与股东间的沟通交流、牵头公司重大项目的开展。

交易部:负责接受基金经理下达的投资指令,在确认投资指令的有效性后加以执行;及时整理交易记录,按照有关规定存档;及时反馈与交易相关的信息等。

清算登记部:负责基金交易的资金调拨、交易清算;组织基金会计核算,对基金名下所发生的证券投资、资金往来等各种事项进行全面、及时、真实的会计核算;与托管行核对帐目,定期公布相关财务会计报表和会计报告;负责基金绩效评估;负责开放式基金的注册登记等。

信息技术部:负责公司信息系统的日常维护;交易、清算、咨讯所需电脑信息的收集、整理和备份;负责设计、建立及维护开放式基金的业务运作系统;负责公司内部办公电脑软硬件的配置、维护,信息集成系统的安装、开通与调试。

人力资源部:负责公司的人力资源管理政策的制定与落实。

综合管理部:负责公司的行政及后勤管理;文档与公文管理;负责公司的企业文化建设;负责公司的安全保卫工作。

财务部:负责公司的财务会计工作,帐务处理,编制公司财务报告;承办公司自有资金的运作等。

合规审计部:根据公司业务发展,对公司新业务、新产品的合规性提出意见建议,对公司的投资业务、市场业务、与基金相关事务及公司行为的合规监控,对公司投资管理、市场营销、公司运营等业务的合规稽核,对公司的各类信息披露的审核及部分内容的报送,负责公司各类法律事务、反洗钱事务,落实公司风险控制委员会相关会规管理的决议,根据公司管理层的指示,就公司合规和内控工作与公司内外部相关机构的协调、沟通。

风险管理部:负责公司投资组合的风险评估,根据投资组合风险评估结果向投资决策机构提供风险管理建议,对公司新的基金、专户产品的风险特征进行分析并提出风险管理措施建议,落实公司风险控制委员会相关风险管理的决议,根据公司管理层的指示,负责就公司的风险管理工作与公司内外部相关机构的协调、沟通。

信息披露负责人:周蕾,021-38505888。

截至2020年12月31日,我公司共有员工265人,其中博士及博士以上有6人,硕士151人,本科92人,专科及以下6人。

3、基金管理业务情况

截至2020年12月31日,华宝基金管理有限公司旗下共管理91只开放式基金,资产管理规模为3,006.99亿元。旗下管理的基金有华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝多策略增长开放式证券投资基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝收益增长混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝稳健收益债券型证券投资基金、华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝新兴产业混合型证券投资基金、华宝医药生物优选混合型证券投资基金、华宝服务优选混合型证券投资基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝生态中国混合型证券投资基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝高端制造股票型证券投资基金、华宝品质生活股票型证券投资基金、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝事件驱动混合型证券投资基金、华宝国策导向混合型证券投资基金、华宝中证医疗指数证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证1000指数证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)、华宝万物互联灵活配置混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝转型升级灵活配置混合型证券投资基金、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金(LOF)、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金、华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)、华宝价值发现混合型证券投资基金、华宝港股通恒生香港35指数证券投资基金(LOF)、华宝中证500指数增强型发起式证券投资基金、华宝港股通香港精选混合型证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)、华宝港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)、华宝宝丰高等级债券型发起式证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝竞争优势混合型证券投资基金、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金。

4、本基金基金经理

张放,硕士。曾在海通期货和长江证券从事研究工作,2014年9月加入华宝基金管理有限公司,先后担任投资经理、基金经理助理等职务。

(二)基金托管人
一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:陈四清
注册资本:人民币35,640,625.7089万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明
二)主要人员情况
截至2020年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
三)基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2020年6月,中国工商银行共托管证券投资基金1094只。自2003年以来,本行连续十七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的73项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。
四)基金托管人的内部控制制度
中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部“一手抓业务拓展,一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在不极权原则下,强化资产托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70(审计标准第70号)审阅后,2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告,表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。
1、内部风险控制目标
保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。
2、内部风险控制组织结构
中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。
3、内部风险控制原则
(1)合法性原则。内控制度应当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的始终。
(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。
(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。
(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。
(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。
(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。
4、内部风险控制措施实施
(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册,严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。
(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。
(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“控制防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。
(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。
(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。
(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。
(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。
5、资产托管部内部风险控制情况
(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。
(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。
(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。
(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

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
根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查日基金合同生效之日起开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,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。
(三)验资机构
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系人:陈露
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
经办注册会计师:陈露、许培菁

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金募集结束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2021年2月5日的资产负债表如下:

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资产	期末余额(2021年2月5日)
资产:	
银行存款	581,163,965.89
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	369,820,861.17
其中:股票投资	369,820,861.17
债券投资	
资产支持证券投资	
基金投资	
贵金属投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	61,244.80
应收股利	
应收申购款	
递延所得税资产	
其他资产	320,268.19
资产总计:	951,376,330.06
负债和所有者权益	期末余额(2021年2月5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	109,107,316.47
应付赎回款	
应付管理人报酬	98,464.34
应付托管费	11,692.86
应付销售服务费	
应付交易费用	351,092.12
应交税费	
应付利息	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	4,747.76
负债合计	109,573,313.55
所有者权益:	
实收基金	855,154,000.00
未分配利润	-13,310,983.50
所有者权益合计	841,843,016.50
负债与持有人权益总计:	951,376,330.06

注:截至2021年2月5日,基金份额净值0.9844元,基金份额总额855,154,000.00份。

八、基金投资组合

截至2021年2月5日,本基金的投资组合如下:
(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	369,820,861.17	38.87
	其中:股票		
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产		
	其中:买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	581,163,965.89	61.09
7	其他资产	391,512.99	0.04
8	合计	951,376,330.06	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1.报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	分类	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	293,693,161.31	34.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,127,699.86	9.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	369,820,861.17	43.93

2.报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
本报告期未持有积极投资部分的股票投资。
(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
1.报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	415,172.00	24,760,858.08	2.94
2	300124	汇川技术	219,638.00	21,649,717.66	2.57
3	000725	京东方A	3,523,000.00	20,750,470.00	2.46
4	600406	国电南瑞	541,100.00	15,821,764.00	1.88
5	600588	用友网络	382,848.00	15,164,609.28	1.80
6	300450	先导智能	147,108.00	13,725,176.40	1.63
7	300454	深信服	47,900.00	13,672,097.00	1.62
8	603986	兆易创新	77,300.00	13,581,610.00	1.61
9	002049	紫光国微	99,500.00	11,060,470.00	1.31
10	002371	北方华创	58,000.00	11,002,600.00	1.31

2.报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本报告期未持有积极投资部分的股票投资。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。
(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金未投资股指期货。
2.本基金投资股指期货的投资政策
本基金未投资股指期货。
(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。
2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金未投资国债期货。
3.本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。
(十一)投资组合报告附注
1. 智能制造ETF基金截至2021年2月5日持仓前十名证券中的用友网络(600588)于2020年7月1日公告,因公司在2017年股票期权与限制性股票激励计划中,未按规定使用回购专用账户进行股份回购,存在业务操作违规,且持有回购股份超过一年,违反有关法律规定,于2019年1月8日收到上海证券交易所对公司及董事会秘书予以口头警示处罚。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2.基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,244.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	183,828.99
7	待摊费用	146,439.20
8	其他	-
9	合计	391,512.99

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
(1)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
(2)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金份额产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
(二)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》及本基金基金合同、托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额