华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书

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

【重要提示】

1、本基金根据2017年7月14日中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1224号)准予注册,进行募集。

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,是证券投资基金中的高预期风险和高预期收益的产品。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

6、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单)、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或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相关规定)。

本基金投资中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

7、基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的80%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保留的现金或者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、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的50%,但在本基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述50%比例的除外。

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。

第一部分 绪言

《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书"或"本招募说明书")依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称"《流动性风险规定》")和其他有关法律法规以及《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中,除非文义另有所指,下列词语或简称具有以下含义:

1、基金或本基金:指华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

2、基金管理人:指华泰证券(上海)资产管理有限公司

3、基金托管人:指中国银行股份有限公司

4、基金合同:指《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书:指《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者:指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、投资人:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、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的合称

22、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构:指华泰证券(上海)资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构

25、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华泰证券(上海)资产管理有限公司或接受华泰证券(上海)资产管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

27、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

28、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务导致基金的基金份额变动及结余情况的账户

29、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人聘请法定机构验资,向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

30、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

31、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过三个月

32、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》:指华泰证券(上海)资产管理有限公司相关业务规则,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守

39、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

44、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%

46、元:指人民币元

47、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

48、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

49、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日的基金份额总数

51、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

52、发起资金:指基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员(指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者,包括但不限于本基金的基金经理,同时也可以包括基金经理之外的投研人员,下同)参与认购本基金的资金。发起资金认购本基金的金额不低于1000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不低于3年

53、发起资金提供方:指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于3年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

54、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

55、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

56、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

57、摆动定价机制:指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

第三部分 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)自由贸易试验区东方路18号21层

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:陈郁

联系电话:(025)83388433

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

(下转A30版)

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已获中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2017年7月14日证监许可[2017]1224号文准予注册的批复。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

2、本基金类别为股票型发起式证券投资基金,运作方式为契约型开放式、发起式。

本基金为发起式基金,在基金募集时,基金管理人将运用公司固有资金、股东资金、公司高级管理人员或者基金经理等人员资金认购本基金份额金额不低于1000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。但基金管理人对本基金的发起认购,并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证,发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿,投资者及发起份额认购人均自行承担投资风险。本基金管理人认购的本基金份额持有期限满三年后,本基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有,届时本基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外,在基金合同生效满3年之日,如果本基金的资产规模低于2亿元,基金合同将自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。因此,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

3、本基金的基金管理人为华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称"本公司"),基金托管人为中国银行股份有限公司,登记机构为华泰证券(上海)资产管理有限公司。

4、本基金募集对象为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。

5、本基金自2018年1月8日至2018年1月26日,通过基金管理人的直销网点(包括直销机构直销中心、网上交易系统等)及基金代销机构的代销网点发售。

基金管理人可根据募集情况,在符合相关法律法规的情况下,在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

6、在基金募集期,投资者通过基金管理人以外的其他销售机构认购,单个基金账户单笔最低认购金额为1000元(含认购费),具体认购金额由销售机构制定和调整。通过本基金管理人直销机构认购,单个基金账户的首次最低认购金额为1万元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1000元(含认购费)。

7、基金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。认购申请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。

8、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明,投资人欲了解本基金的详细情况,请阅读2018年1月3日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》等报刊的《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书》;本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在基金管理人的互联网网站(htamc.htsc.com.cn)。

9、募集期内,本基金还有可能新增或者变更销售机构,敬请留意近期本公司及各销售机构的公告,或拨打本公司及各销售机构客户服务电话咨询。

10、各销售机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

11、投资人可拨打本公司客户服务电话(400-889-5597/95597)或各销售机构咨询电话了解认购事宜。

12、基金管理人可综合各种情况对销售安排及募集期其他相关事项做适当调整。

13、风险提示

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资者在投资本基金前,投资人应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险和合规风险等。本基金的特有风险详见招募说明书"风险揭示"章节。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《基金合同》及《招募说明书》。

本基金主要投资于投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单)、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或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相关规定)。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的80%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保留的现金或者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、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

本基金为股票型基金,是证券投资基金中的高预期风险和高预期收益的产品。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

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。

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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的"买者自负"原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

14、本公告解释权归基金管理人。

一、基金募集的基本情况

(一)基金名称

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

(二)基金代码和简称

基金代码:005502

基金简称:华泰紫金智能量化股票发起

(三)基金类别

股票型发起式证券投资基金。

(四)基金运作方式

契约型开放式、发起式。

(五)基金存续期限

不定期。《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日,若基金资产净值低于2亿元,《基金合同》自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或证监会规定执行。

(六)基金份额发售面值

本基金按初始面值人民币1.00元的价格发售。

(七)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、机构投资者和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。

(八)销售机构

1、直销机构

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2、代销机构

华泰证券股份有限公司、中国银行股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并另行公告。

(九)基金募集期与基金合同生效

1、本基金自2018年1月8日至2018年1月26日公开发售(各代销机构具体营业时间可能有所不同)。基金管理人可根据认购的情况适当延长发售时间,但最长不超过法定募集期;同时也可根据认购和市场情况提前结束发售,如发生此种情况,基金管理人将会另行公告。另外,如遇突发事件,以上基金募集期的安排也可以适当调整。

2、本基金在基金募集期内,基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员认购本基金的发起资金金额不少于1000万元人民币,且承诺认购的本基金份额持有期不少于3年。在满足上述条件时,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

3、基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

二、发售方式及相关规定

(一)基金募集期内,本基金通过各销售机构公开发售。

(二)基金费率

本基金的认购费率按认购金额进行分档。投资人如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。

表1:本基金认购费率

认购金额(M)	认购费率
M < 500万元	1.2%
M ≥ 500万元	1000元/笔

(三)认购份额的计算

1、基金份额认购份额的计算公式为:

(1)认购费用适用比例费率的情形下:

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额发售面值

(2)认购费用适用固定金额的情形下:

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额发售面值

2、认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例1:某投资人投资30万元认购本基金,假设其认购资金的利息为30元,其对应的认购费率为1.2%,则其可得到的认购份额为:

净认购金额=300,000/(1+1.2%)=296,442.69元

认购费用=300,000-296,442.69=3,557.31元

认购份额=(296,442.69+30)/1.00=296,472.69份

即:投资人投资30万元认购本基金,假设其认购资金的利息为30元,则其可得到296,472.69份基金份额(含利息转份额部分)。

(四)募集期间利息的处理方式

有效认购款项在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,其中利息转份额以登记机构的记录为准。

(五)认购限额

投资者通过基金管理人以外的其他销售机构认购,单个基金账户单笔最低认购金额为1000元(含认购费),具体认购金额由销售机构制定和调整。通过本基金管理人直销机构认购,单个基金账户的首次最低认购金额为1万元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1000元(含认购费)。

如本基金单个投资人累计认购的基金份额数超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

三、投资人开户

投资者需具有华泰证券(上海)资产管理有限公司的开放式证券投资基金账户。若已经在华泰证券(上海)资产管理有限公司开立开放式证券投资基金账户的,则不需要再次办理开户手续。

四、个人投资者的开户与认购程序

(一)直销机构

1、本公司直销网点受理个人投资者的开户与认购申请。

2、受理开户及认购的时间:

开户受理时间:正常工作日,周六、周日、法定节日的开户申请视同下一工作日的申请受理。

认购受理时间:认购期间9:30—11:30、13:00—17:00。17:00以后及周六、周日、节假日的认购申请视同下一工作日的申请受理。

本公司网上直销:个人客户认购业务的办理时间为基金份额发售日的任意时间(包括周六、周日及法定节假日),每一发售日17:00以后提交的申请,视为下一工作日提交的申请办理。发售末日截止为当日17:00前。

3、个人投资者申请开立基金账户必须提交下列材料:

(1)本人有效身份证明原件(身份证、军人证或户口本等);

(2)填妥的《账户业务申请表》;

(3)银行卡或储蓄存折复印件加上个人签名;

(4)《一般风险揭示书》、《传真交易协议》、《个人投资者风险承受能力测评表》、《个人税收居民身份声明文件》;

(5)证明专业投资者所需的其他材料。

本公司网上直销:个人投资者申请开立基金账户时请按照华泰证券(上海)资产管理有限公司网站相关指南进行操作,无须提供书面材料。

4、到直销网点办理认购申请时须提交下列材料:

(1)本人有效身份证明原件(身份证、军人证或户口本等);

(2)加盖银行受理章的银行付款凭证回单联原件及复印件;

(3)填妥的《交易业务申请表》并签名;

(4)填妥的《金融产品或金融服务适当性评估结果确认书》或《产品或服务不适当性警示及投资者确认书》并签字(专业投资者免填);

(5)《一般风险揭示书》。

本公司网上直销:个人投资者办理认购申请时请按照华泰证券(上海)资产管理有限公司网站相关指南进行操作,无须提供书面材料。

5、认购资金的划拨

个人投资者在直销网点申请认购基金时不接受现金认购,办理认购前应将足额资金以"支票结算"或"电汇结算"方式通过银行汇入华泰证券(上海)资产管理有限公司直销清算账户。

户名:华泰证券(上海)资产管理有限公司

开户银行:中国银行上海市中银大厦支行营业部

银行账号:439068357540

投资人所填写的票据在汇款用途中必须注明购买的基金名称和基金代码,并确保认购期间每日17:00前到账。投资人若未按上述规定划付,造成认购无效的,华泰证券(上海)资产管理有限公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。

本公司网上直销:通过本公司网上直销认购的个人投资者,应按照本公司网上直销业务相关规定缴款。尚未开户者可同时办理开户和认购手续。

6、注意事项:

(1)一个投资人只能开立一个基金账户。

(2)投资人T日提交开户申请后,可于T+2日(网上直销为T+1日)后(包括T+2日(网上直销为T+1日),如遇非工作日网点不办公则顺延)到办理开户网点查询确认结果,或通过本公司客户服务中心、网上查询系统查询,通过网上交易系统提交开户申请的还可通过网上交易系统查询。

(3)投资人T日提交认购申请后,可于T+2日后(包括T+2日,如遇非工作日网点不办公则顺延)到办理认购网点查询认购接受情况,或通过本公司客户服务中心、网上查询系统查询。认购确认结果可于基金合同生效后到本公司直销中心查询,或通过本公司客户服务中心、网上查询系统查询,通过网上交易系统提交认购申请的还可通过网上交易系统查询。

(4)投资人必须本人亲自办理开户和认购手续。

(5)个人投资者申请认购基金时不接受现金,投资人必须预先在用于认购基金的银行卡(折)中存入足额的资金。

(6)个人投资者认购基金申请须在公布的个人投资者认购时间内办理。

(二)代销机构:

具体程序以各代销机构的规定和说明为准。

五、机构投资者的开户与认购程序

(一)直销机构

1、本公司直销网点受理机构投资者开户与认购申请。

2、受理开户及认购时间:

开户受理时间:正常工作日,周六、周日、法定节假日的开户申请视同下一工作日的申请受理。

认购受理时间:认购期间9:30—11:30、13:00—17:00。17:00以后及周六、周日、节假日的认购申请视同下一工作日的申请受理。

本公司网上直销:机构客户认购业务的办理时间为基金份额发售日的任意时间(包括周六、周日及法定节假日),每一发售日17:00以后提交的申请,视为下一工作日提交的申请办理。发售末日截止为当日17:00前。

3、机构投资者申请开立基金账户时须提交下列材料:

(1)工商行政管理机关颁发的有效法人营业执照(三证合一)复印件并加盖单位公章(事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书复印件);

(2)法定代表人授权经办人办理业务的授权委托书;

(3)法人、业务经办人有效身份证件复印件(身份证或军人证等);

(4)加盖预留印鉴的《业务预留印鉴卡》一式三份(需公章确认);

(5)加盖单位公章的指定银行账户的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》复印件(或指定银行出具的开户证明);

(6)填妥的《账户申请表》,并加盖单位公章、法定代表人私章及经办人签字;

(7)《传真交易协议》一式两份;

(8)《机构投资者风险承受能力评估问卷》、《一般风险揭示书》、《机构税收居民声明文件》、《控制人税收居民身份声明文件》及其他专业投资者证明材料。

注:指定银行账户是指投资人开户时预留的作为赎回、分红、退款的结算账户,账户名称必须同投资人在直销网点账户的户名一致。

本公司网上直销:机构投资者申请开立基金账户时请按照华泰证券(上海)资产管理有限公司网站相关指南进行操作,无须提供书面材料。

4、机构投资者办理认购申请时须提交下列材料:

(1)已填好的《交易业务申请表》,并加盖预留印鉴;

(2)同城支票结算的,加盖银行受理印章的"受理回执"复印件;异地电汇结算的,加盖银行受理印章的"电汇凭证回单"复印件;

(3)前来办理认购申请的机构经办人身份证明原件及复印件;

(4)填妥的《金融产品或金融服务适当性评估结果确认书》或《产品或服务不适当性警示及投资者确认书》并签字;

(5)《一般风险揭示书》(专业投资者免填)。

本公司网上直销:机构投资者办理认购申请时请按照华泰证券(上海)资产管理有限公司网站相关指南进行操作,无须提供书面材料。

5、资金划拨:

机构投资者办理认购前应将足额资金以"支票结算"或"电汇结算"方式通过银行汇入华泰证券(上海)资产管理有限公司直销清算账户。

户名:华泰证券(上海)资产管理有限公司

开户银行:中国银行上海市中银大厦支行营业部

银行账号:439068357540

投资人所填写的票据在汇款用途中必须注明购买的基金名称和基金代码,并确保在认购期间每日17:00前到账。投资人若未按上述规定划付,造成认购无效的,华泰证券(上海)资产管理有限公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。

本公司网上直销:通过本公司网上直销认购的机构投资者,应按照本公司网上直销业务相关规定缴款。尚未开户者可同时办理开户和认购手续。

6、注意事项:

(1)一个投资人只能开立一个基金账户。

(2)投资人T日提交开户申请后,可于T+2日(网上直销为T+1日)到本公司查询确认结果,或通过本公司客户服务中心、网上查询系统查询。本公司将为投资人寄送确认书。

(3)投资人T日提交认购申请后,可于T+2日到本公司直销中心查询认购接受结果,或通过本公司客户服务中心、网上查询系统查询。认购份额确认结果可于基金合同生效后到本公司直销中心查询,或通过本公司客户服务中心、网上查询系统查询。

(4)机构投资者认购基金申请须在公布的机构投资者认购时间内办理。

(二)代销机构:

具体程序以各代销机构的规定和说明为准。

六、清算与交割

1、有效认购款项在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,其中利息转份额以基金登记机构的记录为准。

2、本基金权益登记由登记机构在基金募集结束后完成。

七、基金的验资与基金合同的生效

本基金在基金募集期内,基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员认购本基金的发起资金金额不少于1000万元人民币,且承诺认购的本基金份额持有期不少于3年。在满足上述条件时,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,基金合同生效;否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息;

3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

八、本次发售当事人或中介机构

(一)基金管理人

名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司

住所及办公地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层

成立时间:2014年10月16日

法定代表人:崔春

注册资本:26亿元人民币

(二)基金托管人

名称:中国银行股份有限公司

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:陈四清

成立时间:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]24号

(三)销售机构

1、直销机构

名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司

住所及办公地址: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

客服电话:4008895597/95597

公司网站:htamc.htsc.com.cn

2、代销机构

(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

法定代表人:周易

客服电话:95597

公司网站:http://www.htsc.com.cn/

(2)中国银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:陈四清

客服电话:95566

公司网站:http://www.boc.cn/

(3)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

客服电话:95587

公司网站:http://www.csc108.com/

(4)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

客服电话:95551

公司网址:http://www.chinastock.com.cn/

(5)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

法定代表人:其实

客服电话:95021

公司网站:http://fund.eastmoney.com/

(6)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人:胡学勤

客服电话:4008219031

公司网站:https://www.lufunds.com/

(7)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

法定代表人:江卉

注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

客服电话:95118

公司网站:http://jr.jd.com/

(8)嘉实财富管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层

法定代表人:赵学军

客服电话:400-021-8850

公司网站https://www.harvestwm.cn/

(五)登记机构

华泰证券(上海)资产管理有限公司

住所及办公地址: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)28972112

传真:(021)28972120

联系人:朱鸣

(六)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19楼

办公地址:上海市银城中路68号19楼

负责人:俞卫锋

电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

联系人:丁媛