华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
重要提示

华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)根据2019年4月11日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》(证监许可[2019]728号)予以注册,进行募集。

华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”)保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书在中国证监会注册,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。

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。

本基金为华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证红利低波动ETF”或“目标ETF”)的联接基金,其投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。本基金投资于证券期货市场,基金净值会因为证券期货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,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并来结果投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括:本基金特有风险,主要包括指数波动的风险、指数编制机构发布数据错误的风险、基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险、基金由目标ETF的联接基金变更为直接投资目标ETF取的指数波动股的指数基金的风险等;市场风险:流动性风险;管理风险;其他风险等等。本基金是ETF联接基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

投资者应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

本基金由基金管理人依照《基金法》、《基金合同》和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资者应当通过本公司或代销机构买入基金份额,基金代销机构名单请见本公告。本基金在募集期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后,有可能面临基金份额净值跌破1.00元,从而遭受损失的风险。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

一、基金募集基本情况

1、基金名称
华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称:华泰柏瑞中证红利低波ETF联接A/C
基金代码:007466(A类),007467(C类)
2、基金类别
指数基金、联接基金
3、基金运作方式
契约型开放式
4、基金存续期限
不定期
5、基金份额面值
本基金基金份额初始发售面值为人民币1.00元。
6、基金投资目标
紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
7、募集对象
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。
8、销售机构与销售地点
(1)直销机构
华泰柏瑞基金管理有限公司
(2)代销机构
在中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交信证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、方联证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、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(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、长江证券(上海)资产管理有限公司、中国期货有限公司、大连证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、大连证券有限责任公司、乾隆盛泰基金销售(北京)有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、济安财富(北京)基金销售有限公司、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、万家理财基金销售有限公司、万德保险代理有限公司、联储证券有限责任公司、天津万家财富资产管理有限公司、宜信普泽(北京)基金销售有限公司、大同证券有限责任公司、大同证券有限责任公司、蚂蚁基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳前海微众银行股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、宜信普泽(北京)基金销售有限公司、上海大智慧财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、信海(北京)基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、北京格上富信基金销售有限公司、深圳前海排排网基金销售有限公司、深圳前海排排网基金销售有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司、上海利得基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、北京格上富信基金销售有限公司、深圳前海微众银行股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、上海有鱼基金销售有限公司、上海通华财富资产管理有限公司、深圳盈信基金销售有限公司、中民财富基金销售(上海)有限公司、深圳前海财厚基金销售有限公司、北京辉腾汇富基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳市前海财厚基金销售有限公司、北京辉腾汇富基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳市前海财厚基金销售有限公司、北京辉腾汇富基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司(以下统称“销售网点”)公开发售。

(3)如本基金在募集期间新增代销机构,则将另行公告。

9、募集时间安排与基金合同生效
(1)本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过三个月。
(2)本基金自2019年6月13日至2019年7月10日公开发售(各代销机构具体营业时间可能有所不同)。在上述时间段内,本基金向个人投资者和机构投资者同时发售。本公司根据认购的情况可适当延长发售时间,但最长不超过法定募集期限;同时也可根据认购和市场情况提前结束发售。

(3)基金募集期满,本基金符合法律法规规定的基金合同生效条件的,基金管理人应按照规定在办理基金验资和备案手续后公告本基金合同生效。

募集期间认购资金利息在募集期结束时归入投资者认购金额中,折合成基金份额,归投资者所有。募集资金利息的数额以基金注册登记机构的记录为准。

基金合同生效前,投资者的认购款项只能存入商业银行,不作它用。

(4)若三个月的募集期满,本基金合同未达到法定生效条件,则本基金合同不能生效,本公司将承担全部募集费用,并将所募集的资金加计银行同期活期存款利息在募集期结束后30天内退还基金认购人。

二、认购方式与相关规定

1、认购方式
本基金采取金额认购、全额赎款方式和前端收费模式。

2、认购费率
本基金A类基金份额在投资者认购时收取认购费,C类基金份额在认购时不收取认购费。
投资者在认购A类基金份额时,适用的认购费率如下表所示。

认购金额(M,含认购费,元)	认购费率
M<100万	1.00%
100万≤M<300万	0.80%
300万≤M<500万	0.60%
M≥500万	1000元/笔

投资者重复认购A类基金份额的,须按每次认购时对应的费率档次分别计费。
认购费将用于支付募集期间合计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出,不计入基金财产。
本基金C类基金份额不收取认购费。
认购份额的计算方法如下:
认购本基金A类基金份额的认购费用采用前端收费模式,即在认购A类基金份额时缴纳认购费;认购本基金C类基金份额不收取认购费。
投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购资金在基金募集期间所产生的利息折成基金份额,归投资者所有。

(1)认购A类基金份额时,投资者的总认购份额的计算方式如下:
净认购金额=认购金额/(1+认购费率)
认购份额=认购金额÷净认购金额
当认购费用为固定金额时,投资者的总认购份额的计算方式如下:
认购份额=认购金额-认购费用
当认购费用为固定金额时,投资者的总认购份额的计算方式如下:
认购份额=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+募集期利息)/基金份额初始面值
净认购金额=认购金额-认购费用
认购份额=(净认购金额+募集期利息)/基金份额初始面值
两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。
例:某投资者投资10,000元认购本基金A类基金份额,如果募集期内认购资金获得的利息为10元,则其可得到的A类基金份额计算如下:
净认购金额=10,000/(1+1.00%)=9,900.99元
认购费用=10,000-9,900.99=99.01元
认购份额=(9,900.99+10)/1.00=9,910.99份
即投资者投资10,000元认购本基金A类基金份额,加上认购资金在募集期内获得的利息,可得到9,910.99份A类基金份额。

(2)认购C类基金份额时,投资者的总认购份额的计算方式如下:
本基金的C类基金份额不收取认购费用,认购资金额即为净认购金额。
认购份额=(净认购金额+募集期利息)/基金份额初始面值
例:某投资者投资10,000元认购本基金C类基金份额,如果募集期内认购资金获得的利息为10元,则其可得到的C类基金份额计算如下:
认购份额=(10,000.00+10)/1.00=10,010.00份
即投资者投资10,000元认购本基金C类基金份额,加上认购资金在募集期内获得的利息,可得到10,010.00份C类基金份额。

3、投有关规定,基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费在基金认购费中列支。

4、在基金募集期内,除发售当天有规定,基金管理人的网上交易系统每个基金账户首次最低认购金额为10元人民币,单笔认购最低金额为10元人民币;代销机构以代销机构的规定为准;直销柜台每个基金账户首次最低认购金额为50,000元人民币,已在直销柜台有认申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制,单笔认购最低金额为10元人民币。

各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的,以各代销机构的业务规定为准。

5、在募集期内,投资者可多次认购,原则上对单一投资者在募集期间累计认购份额不设上限。法律法规或监管规则另有规定的,从其规定。

三、个人投资者的开户与认购程序

个人投资者可以通过本公司网上直销或到各代销网点办理本基金的认购。

1、本公司网上直销

(1)网上直销接受单笔认购金额在10元(含10元)以上的个人投资者认购。

(2)网上直销网址:www.huatai-pb.com。

(3)业务办理时间:2019年6月13日至2019年7月10日16:00,期间7*24小时全天候受理(含周六、周日)。

(4)认购手续:

1)未开立本公司开放式基金账户的个人投资者,可持工、农、中、建、招、民生等银行借记卡在www.huatai-pb.com按照“网上开户”页面提示完成网上开户,当日开户,当日即可认购(上述业务办理时间内)。

2)已开立本公司开放式基金账户,但未开通过华泰柏瑞网上直销的个人投资者,可持工、农、中、建、招、民生等银行借记卡在www.huatai-pb.com按照“网上开户”页面提示开通网上直销。当日开通,当日即可认购(上述业务办理时间内)。

3)已开通本公司网上直销的个人投资者可于上述业务办理时间,直接在www.huatai-pb.com“网上交易”内认购本基金。

(5)网上直销咨询电话:400-888-0001(免长途费)。

2、本公司直销柜台

(1)业务办理时间:基金发售日的9:30-16:00(周六、周日不营业)。

(2)提供下列资料办理基金的开户和认购手续:

1)本人现时有效身份证件原件及复印件;

2)加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件;

3)指定银行账户证明;

4)按本公司要求提供以上及相关材料。

注:上述3)项中“指定银行账户”是指:办理开户的投资者需指定一个银行账户作为赎回、分红以及认购/申购无效资金退款等资金结算汇入账户。账户证明可以是银行存折、借记卡等。

(3)在认购期内,将足够认购资金汇入本公司指定的任一直销资金专户。

1)中国银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:442959213750
开户银行名称:中行上海中银大厦支行

2)建设银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:31001520313050005668
开户银行名称:建行上海浦东分行

3)工商银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:1001164829013352678
开户银行名称:工行上海分行金茂大厦支行

4)招商银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:216089281810001
开户银行名称:招商银行上海市分行营业部

5)兴业银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:216200100101340769
开户银行名称:兴业银行上海市分行

6)交通银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:320006669001801051412
开户银行名称:交通银行江苏省分行营业部

(4)注意事项:

若个人投资者的认购资金在认购中请当日17:00之前未到本公司指定的直销资金专户,则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期(即有效申请日)以资金到账日为准。

四、代销机构投资者的开户与认购程序

机构投资者可在本公司直销柜台或各代销网点办理基金的开户和认购。

1、本公司直销柜台

(1)业务办理时间:基金发售日的9:30-16:00(周六、周日不营业)。

(2)开户及认购程序如下:

1)认购期间,投资人以电汇或支票主动付款方式将足额认购资金汇入本公司指定的以下任一直销资金专户:

a)中国银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:442959213750
开户银行名称:中行上海中银大厦支行

b)建设银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:31001520313050005668
开户银行名称:建行上海浦东分行

c)工商银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:1001164829013352678
开户银行名称:工行上海分行金茂大厦支行

d)招商银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:216089281810001
开户银行名称:招商银行上海市分行营业部

e)兴业银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:216200100101340769
开户银行名称:兴业银行上海市分行

f)交通银行
户名:华泰柏瑞基金管理有限公司
账号:320006669001801051412
开户银行名称:交通银行江苏省分行营业部

注:上述f)项中“指定银行江苏省分行营业部”是指:办理开户的投资者需指定一家商业银行开立的银行账户作为投资者赎回、分红及无效认(申)购的资金退款等资金结算汇入账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户。

2)提供下列资料办理基金的开户和认购

a)加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及副本原件;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原件及加盖单位公章的复印件;

b)基金业务授权委托书原件;

c)业务经办人有效身份证件原件及复印件;

d)印鉴卡一式三份;

e)机构指定银行出具的银行账户证明;

f)《投资者基本信息表》;

g)填妥的机构基金开户申请表并加盖单位公章和基金认购申请表(加盖预留印鉴章);

h)授本公司要求提供以上及其他相关材料。

(3)注意事项:

若机构投资者的认购资金在认购申请当日17:00之前未到本公司指定的直销资金专户,则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期(即有效申请日)以资金到账日为准。

2、代销本基金的销售机构名单

华泰证券股份有限公司

五、认购费用

1、本基金较低的申购费率,可以给合与投资理财、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、OFI托管处、养老金托管处、消费处、根据处、跨境托管运营处、监管稽核处等10个部院处室,在它集合要投资的基金管理公司中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国证券报证券周报分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、投信审批部任职领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务管理工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀海,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

邓绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑红,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户管理的拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经验情况

作为第一批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的理念,不断加强风险管理和内控管理,从内部控制的第一道防线,充分发挥督察长和合规法律部对各岗位、各部门,各机构、各项业务全面监察稽核作用,建立内部控制的第三道防线。

(4)信息与内部

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道,保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,并及时送达适当的人员进行处理。

(5)内部监控

内部监控由公司风险管理与审计部,稽核监察委员会和合规法律部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的内控法律部,其中监察稽核人员履行内部稽核监督、检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的风险,及时提出改进意见,促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

(1)基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

(2)本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四 基金托管人

(一)基金托管人基本情况

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:250,010,916,875元人民币
存续期限:持续经营
联系人:汪莹百
联系电话:(010)67559 5096
中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先,国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码:0939),并于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年6月末,本集团资产总额228,051.82亿元,较上年末增加6,807.96亿元,增幅3.08%。上半年,本集团盈利平稳增长,利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元,增幅5.42%;净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元,增幅6.08%。

2017年,本集团先后荣获香港《亚洲银行》“2017年中国最佳银行”、美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳创新奖”、《财经杂志》“2017最佳金融创新奖”及中国银行协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。本集团在美国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位;在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行设置产托管业务部,下设综合与规划管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、OFI托管处、养老金托管处、消费处、根据处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个部院处室,在它集合要投资的基金管理公司中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工315余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国证券报证券周报分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、投信审批部任职领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部,营业部并担任副行长,长期从事信贷业务管理