(上接A25版)

蔡目荣先生,国内投资部副总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理、华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理、华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理。

(三)基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责:

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、办理本基金备案手续;

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照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收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制季度、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回对价,编制申购赎回清单;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、按照规定召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、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者实施其他法律行为;

12、中国证监会规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不从事下列行为:

(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待其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)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益;

(3)不泄漏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。

(五)基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险(如灾难)等。

针对上述各种风险,基金管理人建立了一套完整的风险管理体系,具体包括以下内容:

(1)搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标,设置相应的组织机构,建立清晰的责任线路和报告渠道,配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

(2)识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

(3)分析风险。检查存在的控制措施,分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

(4)度量风险。评估风险水平的高低,既有定性的度量手段,也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别,每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标,测量其数值的大小。

(5)处理风险。将风险水平与既定的标准相对比,对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险,控制相对宽松一点,但仍加以定期监控,以防其超过预定标准;而对较为严重的风险,则制定适当的控制措施;对于一些后果可能极其严重的风险,则除了严格控制以外,还准备了相应的应急处理措施。

(6)监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视,并定期评价其管理绩效,在必要时结合新的需求加以改变。

(7)报告与咨询。建立风险管理的报告系统,使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况,并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

(1)内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程,结合程序控制,建立合理的内控程序,维护内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位,各部门和岗位在职能上保持相对独立性;公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作,独立进行。

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门,应当在物理上和制度上适当隔离;对因业务需要必须知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性,尽量降低经营运作成本,保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定,并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节,并普遍适用于公司每一位员工,不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制,内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性,并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

(2)内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

(3)督察长制度

公司设督察长,督察长由公司总经理提名,董事会聘任,并应当经全体独立董事同意。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时,应当及时告知公司总经理和相关业务负责人,提出处理意见和整改建议,并监督整改措施的制定和落实;公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的,督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

(4)监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度,在所赋予的权限内,按照所规定的程序和通当的方法,进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性;负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况;评价各项内控制度执行的有效性,对内控制度的缺失提出补充建议;进行日常风险监控工作;协助评价基金财产风险状况;负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

(1)基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(2)基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制制度。

四、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34,932,123.46万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

(二)主要人员情况

截至2018年12月,中国工商银行资产托管部共有员工202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2018年12月,中国工商银行共托管证券投资基金923只。自2003 年以来,本行连续十五年获得香港《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64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,在积极拓展各项托管业务的同时,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2006、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,表明独立第三方对我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“自控防线”、“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。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、网下现金发售和网下股票发售直销机构

名称:华宝基金管理有限公司

住所: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

法定代表人:孔祥清

直销柜台电话:021-38505731、38505732、021-38505888-301或302

直销柜台传真:021-50499663、50988055

联系人:章希

网址:www.fsfund.com

2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

3、网上现金发售代理机构

投资人可直接通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构,并另行公告。

(二)登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

联系人:朱立元

联系电话:010-58598839

传真:010-58598907

(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

注册地址: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

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼

办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼

负责人:曾顺福

联系电话:021-61418888

传真:021-63350177

联系人:曾浩

经办注册会计师:曾浩 冯适

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

准予注册文件:中国证监会证监许可【2019】993号

准予注册日期:2019年6月5日

(一)基金的类别、运作方式与存续期限

1、基金的类别:股票型证券投资基金

2、基金的运作方式:交易型开放式

3、基金存续期限:不定期

(二)募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

(三)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。

(四)募集方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。

网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告,基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构。

投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所,或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式,请参见基金份额发售公告。

基金投资人在募集期内可多次认购。

(五)基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,认购价格为1.00元。

(六)基金开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户,上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或上海证券交易所基金账户。

1、如投资者需新开立上海证券账户,则应注意:

(1)上海证券交易所基金账户只能进行现金认购和二级市场交易;如投资者需要使用中证科技龙头指数成份股中的上海证券交易所A股账户或上市股票进行网下股票认购或者进行基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户;如投资者需要使用中证科技龙头指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则应同时开立上海证券账户和深圳证券交易所A股账户。

(2)开户当日无法办理指定交易,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2、如投资者已开立上海证券账户,则应注意:

(1)如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

(2)当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购的1个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

(七)认购费用

本基金的认购费用由投资者承担,认购费率如下图表所示:

认购份额(份)	认购费率
100万(含)以上	每笔1000元
大于等于50万,小于100万	0.5%
小于50万	0.8%

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、登记结算费、销售费及市场推广等支出,不计入基金资产。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定生效,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购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。

(八)网上现金认购

1、认购时间:详见基金份额发售公告。

2、通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购佣金、认购金额的计算公式为:

认购佣金=认购份格×认购份额×佣金比率

(或若适用固定费用的,认购佣金=固定费用)

认购金额=认购份格×认购份额×(1+佣金比率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购份格×认购份额+固定费用)

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取,投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例:某投资者通过网上现金认购1,000份本基金,假设发售代理机构确认的佣金比率为0.8%,则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金=1.00×1,000×0.8%=8元

认购金额=1.00×1,000×(1+0.8%)=1,008元

即投资者需准备1,008元资金,方可认购到1,000份本基金基金份额。

3、认购限额:网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资者应以上海证券账户认购,可以多次认购,累计认购份额不设上限。

4、认购申请:投资者在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收:T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请,由该发售代理机构冻结相应的认购资金,登记机构进行清算交收,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作日将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

6、认购确认:在募集期结束后3个工作日之后,投资者可通过其办理认购的销售机构或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

(九)网下现金认购

1、认购时间详见基金份额发售公告。

2、通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算:

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购费用、认购金额的计算公式为:

认购金额=认购份格×认购份额×(1+认购费率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购份格 ×认购份额+固定费用)

认购费用=认购份格×认购份额×认购费率

(或若适用固定费用的,认购费用=固定费用)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

认购费用由基金管理人收取,投资者需以现金方式交纳认购费用。通过基金管理人进行网下现金认购款项在基金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。

例:某投资者到基金管理人直销网点认购100,000份基金份额,假定认购金额产生的利息为10 元,则需准备的资金金额计算如下:

认购费用=1.00×100,000×0.8%=800元

认购金额=1.00×100,000×(1+0.8%)=100,800元

净认购份额=100,000+10/1.00=100,010份

即投资人若通过基金管理人认购本基金100,000份,需准备100,800元资金,假定该笔认购金额产生利息10元,则投资人可得到100,010份本基金基金份额。

3、通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算:同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、认购限额:网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购,每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。

5、认购手续:投资人在认购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理相关认购手续,并备足认购资金。认购一经确认不得撤销。

6、清算交收:T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请,由基金管理人于T+2日进行有效认购款项的清算交收,将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。现金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,认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请,由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的基础上一个工作日,各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后,通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后,登记机构进行清算交收,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

7、认购确认:在募集期结束后3个工作日之后,投资人可通过其办理认购的销售机构或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

(十)网下股票认购

1、认购时间详见基金份额发售公告,具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2、认购限额:网下股票认购以单只股票股数申报,用以认购的股票必须是中证科技龙头指数成份股和已公告的备选成份股(具体名单以基金份额发售公告为准)。单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者应以A股账户认购,可以多次提交认购申请,累计申报股数不设上限。

3、认购手续:投资者在认购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理认购手续,并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

4、特殊情形

(1)已公告的将被调出中证科技龙头指数的成份股不得用于认购本基金。

(2)限制个股认购规模:基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况,决定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。

(3)临时拒绝个股认购:对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常或长期停牌的个股,基金管理人可不经公告,全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4)根据法律法规和基金不得持有的标的指数成份股,将不能用于认购本基金。

5、清算交收:网下股票认购最后一日,发售代理机构将投票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人,基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。基金募集期结束后,登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结,并将投资者深圳市场网下认购股票过户至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的,基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金,并从投资者的认购份额中扣除,为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据,将上海市场和深圳市场的股票过户至本基金的证券账户。基金合同生效后,登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

6、认购份额的计算公式:

$$投资者的认购份额=\sum_{i=1}^{n}第i只股票认购期最后一日的均价\times有效认购数量/1.00$$

其中,

(1)i代表投资者提交认购申请的第i只股票,n代表投资人提交的股票总只数。如投资者仅提交了1只股票的申请,则i=1。

(2)“第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据,以该股票的总成交金额除以总成交股数计算,以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交,则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增)、配股等权益变动,则由于投资者获得了相应的权益,基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购日的均价进行调整:

除息:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

送股:调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/(1+每股送股比例)

配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股配股比例)

送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

除息、送股且配股:调整后价格=(网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息)/(1+每股送股比例+每股配股比例)

(3)“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中,

1)对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限为:

$$q_{max}=\begin{cases}Cash\div p, & \sum_{i=1}^{n}p_i\times q_i\le Cash\\ \left(Cash+\sum_{i=1}^{n}p_i\times q_i\times 105\%\right)\div p, & \sum_{i=1}^{n}p_i\times q_i>Cash\end{cases}$$

q_{max}为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量,Cash为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额,p_i为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积,w为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日中证科技龙头指数中的权重(认购期间如有中证科技龙头指数调整公告,则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及中证科技龙头指数编制规则计算调整后的中证科技龙头指数构成权重,并以其作为计算依据),p为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限,则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

2)若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行,基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

7、特别提示:投资者应根据法律法规及上海证券交易所相关规定进行股票认购,并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

(十一)募集期间认购资金与股票

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额归投资者所有,其中利息转份额以登记机构的记录为准;网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息,计入基金财产,不折算为投资者基金份额。

募集的股票根据交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户,最终将投资者申请认购的股票过户至基金证券账户。投资者的认购股票在募集冻结期间的权益归投资者所有。

七、基金备案

(一)基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额(含网下股票认购所募集的股票市值)不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或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,网下股票认购募集的股票由发售代理机构予以冻结,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

(二)基金合同不能生效时募集资金的处理方式

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。对于基金募集期间网下股票认购募集的股票,发售代理机构应予以解冻,基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

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

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形之一的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

八、基金份额折算与变更登记

基金合同生效后,本基金可以进行份额折算。

一、基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算基准日,并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理,并由登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人另行公告。

基金份额折算后,本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除因小数点后的尾数处理外,基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后,基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记机构遇特殊情况无法办理,基金管理人可延迟办理基金份额折算。

三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

九、基金份额的上市交易

(一)基金份额的上市

基金合同生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》,向上海证券交易所申请基金份额上市:

1、基金募集金额(含网下股票认购所募集的股票市值)不低于2亿元;

2、基金份额持有人不少于1000人;

3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前,基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的,基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书。

(二)基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易、停复牌、终止上市交易应遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

(三)终止上市交易

基金份额上市交易后,有下列情形之一的,上海证券交易所可终止基金的上市交易,并报中国证监会备案:

1、不再具备本部分第(一)条规定的上市条件;

2、基金合同终止;

3、基金份额持有人大会决定终止上市;

4、基金合同约定的终止上市的其他情形;

5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金终止上市公告。

若因上述1、3、4、5项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的,本基金将在履行适当程序后由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金,而无需召开基金份额持有人大会。若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

(四)基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购赎回清单,中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据,计算基金份额参考净值(IOPV),并将计算结果向上海证券交易所发送,由上海证券交易所对外发布,仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为:

基金份额参考净值=(申购、赎回清单中必须现金替代的替代金额+申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购、赎回清单中的预估现金部分)/最小申购赎回单位对应的基金份额。