

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摘要

(2019年第2号)

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。本基金合同已于2018年2月1日正式生效。
- 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)基金的意思、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投资基金投资的“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,由投资者自行承担。
- 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: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,基金管理人将在基金募集过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等等。
- 5.本基金为股票型基金,是证券投资基金中的中高风险和高预期收益的产品。本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、中小板及符合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)。
- 7.本基金投资于中小企业私募债券,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。当发生主体信用资质恶化时,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。
- 8.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所保证金后,应当保持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%。
- 9.本基金单一投资者持有基金份额比例不得低于基金份额总额的50%,但在本基金运作过程中基金份额持有人数量导致被动超过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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年7月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日(财务数据未经审计)。

第一部分 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)自由贸易试验区基隆路6号1222室
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
成立日期:2014年10月16日
注册资本:26亿元
存续期间:持续经营
联系人:周维佳
联系电话:4008895597
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16日成立,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行长、金融结构部副部长,嘉实基金管理有限公司固定收益部总监,中国国际信托投资公司资产管理部副经理,执行总经理,董事总经理,兼任中国香港证券(上海)资产管理有限公司董事长、工友林先生,董事,毕业于东北财经大学工业经济专业,获学士学位。曾在徐州机械集团任职,1998年5月加入华泰证券,曾任徐州营业部总经理助理、徐州中山南路营业部副总经理、广州机场路营业部总经理、南京解放路营业部总经理、机构业务部总经理、上海分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司经纪及财富管理总部(经纪业务总部)总经理,职工监事,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事。
- 2.高级管理人员
费雷先生,董事,毕业于北方交通大学财务会计专业,获学士学位。曾任南京铁路分局浦口车辆段财务科会计,江苏省农业投资公司财务部主管会计,江苏国际信托投资公司财务部副部长、江苏省国际信托投资公司2009年9月加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。
- 3.基金管理人监事会成员
戴梁斐女士,监事,毕业于南京理工大学会计学专业,获学士学位。曾在南京金笔厂、中外合资南京东兴公司任职,1994年12月加入华泰证券,曾任稽查监察部高级经理,计划财务部高级经理,独立存管部副经理,上海管理总部财务清算中心主任,计划财务部副经理兼清算中心主任等职务。现任华泰证券股份有限公司运营中心总经理,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事,兼任证通股份有限公司董事。
- 4.高级管理人员
崔春女士,董事长。(简历请参上述董事会成员介绍)
前女士,副总经理(主持工作),毕业于复旦大学经济学院世界经济专业,获硕士学位,曾任东方证券有限责任公司、富国基金管理有限公司、海富通基金管理有限公司任职,曾任中国国际金融有限公司资产管理部机构事务部负责人、执行总经理。2015年3月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司副总经理(主持工作)。
- 5.首席风险官、合规总监、督察长,毕业于武汉大学政治经济学专业,获博士学位。曾任建设银行总行清算中心副主任科员,主任科员,副处长,中国证监会发行监管部有限责任公司业务发展规划部总监、基金业务部主持工作副总监、总监,长安基金管理有限公司督察长。2016年4月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司首席风险官、合规总监、督察长。
- 6.首席经济学家,副总经理,毕业于北京航空航天大学计算机应用专业,获硕士学位。曾任华泰证券研究所金融工程分析师,上海摩根基金管理有限公司风险管理部高级经理,国泰基金管理有限公司稽核监察部总监助理,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理、副总经理,兼任风险管理部总监。2015年1月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司副经理。
- 7.基金经理
熊志勇,英国考文垂大学金融学硕士,曾任华泰基金高级基金经理。基金经理助理,国投瑞银基金助理、量化及衍生品负责人,鹏华基金量化投资部总经理,上投摩根量化投资部总监,上海“环庆”投资投资总监。2010年11月27日至2011年8月17日任职国投瑞银和300指数分级证券投资基金基金经理。2016年11月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任基金量化部负责人、华泰基金中证红利波动指数型发起式证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。
- 8.毛甜,武汉大学金融工程硕士研究生,曾任中国航天工程咨询中心分析师,国信证券经济研究所金融工程助理分析师,光大富尊投资有限公司研究员,投资经理。2017年7月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰基金中证红利波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。
- 9.公募基金投资决策委员会成员:
主席:熊志勇先生(基金量化部负责人,华泰基金中证红利波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理)
成员:陈玉强先生(交易部负责人)
- 10.毛甜女士(华泰基金中证红利波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理)
- 11.上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 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.办理基金备案手续;
- 3.自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- 4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- 5.建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人其他财产独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
- 6.除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
- 7.依法接受基金托管人的监督;
- 8.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金申购赎回的价格;
- 9.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- 10.编制季度、半年度和年度基金报告;
- 11.严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
- 12.保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
- 13.按《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基金收益;
- 14.按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- 15.依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- 16.按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
- 17.确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
- 18.组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 19.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
- 20.因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
- 21.监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管

人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

- 22.当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
- 23.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实施其他法律行为;
- 24.基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
- 25.执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- 26.建立并保存基金份额持有人名册;
- 27.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人承诺

- 1.基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;
- 2.基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:
(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平对待对待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反承诺收益或者承担损失;
- 3.基金管理人承诺加强投资者教育,切实履行信息告知义务,提示投资人从事相关交易的风险,并告知其风险承受能力,对高风险投资设立警示,警示他人从事相关的交易活动;
- 4.基金管理人承诺严格遵守法律法规,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反法律法规的行为发生;
- 5.基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同的行为发生;
- 6.基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责;
- 7.基金管理人承诺不从事其他法律法规禁止从事的行为。

五、基金业绩承诺

- 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、受雇人或其他第三人牟取利益;
- 3.不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚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;

六、基金管理人的内部控制制度

1.内部控制制度概述
为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作,有效防范、规避和化解各类风险,最大限度保护利益相关者及公司的合法权益,本基金管理人建立了科学完善、控制严密、运行高效的内部控制制度,并承诺严格执行。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,贯穿公司运营的所有环节,其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2.内部控制目标

- (1)确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营观念。
- (2)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。
- (3)建立行之有效的风险控制系统,保障公司资产及客户资产的安全完整,维护公司股东的合法权益,并最大限度保护投资者的合法权益。

3.内部控制原则

- (1)确保公司内部控制制度符合国家有关法律、法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营观念。
- (2)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。
- (3)建立行之有效的风险控制系统,保障公司资产及客户资产的安全完整,维护公司股东的合法权益,并最大限度保护投资者的合法权益。
- (4)确保公司业务记录、财务信息和其他信息真实、准确、完整、及时。
- (5)保证公司内部规章制度的贯彻执行,提高公司运营效益。

3.内部控制原则

- (1)全面性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一;覆盖公司各个部门和各级岗位,渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- (2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内部控制的有效性。
- (3)独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立,公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离;公司设立合规风控部,承担内部控制监督检查职能,对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。
- (4)相互制约原则。内部控制和岗位的设置必须权责分明、相互制衡;前台业务运作与后台管理支持适当分离。
- (5)成本效益原则。公司内部控制和岗位的设置必须权衡风险、经营管理、风险控制等因素,运用科学化的经营管理方法,以合理的成本实现内部控制目标。

4.控制环境

内部控制环境主要包括公司所有权结构、经营理念、人力资源、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制制度、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

5.内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系,通过定期与不定期风险评估,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,发现风险来源和类型,针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案,及时防范和化解风险。

控制活动主要包括:授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。

6.内部控制的主体

内部控制的主要内容包括:市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制与人力资源控制等。

第二部分 基金托管人

一、基本情况

名称:中国银行银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖百肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万肆仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:刘连舸
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]124号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942

中国银行客服电话:95566
二、基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,具备海外工作学习或培训经历,60%以上员工具有硕士学位,均为中级及以上职称,为给客户专业、优质的托管服务。中国银行为境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFI、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至2019年6月30日,中国银行已托管716只证券投资基金,其中境内基金676只,QDII基金40只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险控制工作是中国银行全面风险控制工作的重要组成部分,秉承中国银行风险管理理念,坚持“规范运作、稳健经营”的原则,中国银行托管业务风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设计、制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审计,先后获得基于“SAS70”、“AAAFI/06”、“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流审计审阅标准的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内部控制制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定,基金托管人发现基金管理人存在违法违规、违反法律法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,并及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

- 1.直销机构
名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室
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:(025)183387046
传真:(025)183387074
联系人:孙晶磊
网站:http://htmc.hscc.com.cn/
- 2.其他销售机构
(1)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市江东中街228号
办公地址:江苏省南京市江东中街228号
法定代表人:周易
客服电话:95597
网址:www.hscc.com
- (2)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
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:李静雯
客服电话:95587
网址:www.csc108.com
- (3)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
办公地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
联系人:李国欣
客服电话:4008888888
网址:www.chinastock.com.cn
- (4)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市复兴门内大街1号
办公地址:北京市复兴门内大街1号
法定代表人:刘连舸
联系人:郭文霞
客服电话:95566
网址:www.boc.cn
- (5)交通银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系人:张伟

客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(6)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
客服电话:020-89620066
网址:www.yingmi.com

(7)泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:李春光
联系人:王潇
客服电话:4006411999
公司网址:www.taichengcaifu.com

(8)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区南汇路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:陆敏
客服电话:400-700-9655
公司网址:www.howbuy.com

(9)北京鼎耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区延庆路开发西区百景时2号楼236室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院泰康金融中心大厦38层
法定代表人:张冠宇
联系人:王国柱
客服电话:4008199868
公司网址:www.tdyhfund.com

(10)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
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人:其实
联系人:何薇
客服电话:95021
网址:fund.eastmoney.com

(11)北京广信诺财富管理投资管理有限公司
注册地址:北京市亦庄经济开发区龙光路19号1幢4层1座401
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座
法定代表人:江萍
联系人:韩晶晶
客服电话:400-098-8511
网址:kentemj.com

(12)上海鼎信基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:王之光
联系人:程晨
客服电话:400-821-9031
网址:www.lidinfo.com

(13)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
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系人:余永健
客服电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn

(14)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO塔3座19层
法定代表人:钟奕坚
联系人:王旻
客服电话:4000-618-518
网址:danjuanapp.com

(15)上海长莱基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高路路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层
法定代表人:张珏伟
联系人:史爱敏
客服电话:400-820-2899
网址:www.enchfund.com

(16)奕丰基金销售有限公司(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastp.com

(17)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦307
法定代表人:杨颖
联系人:李海婧
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfund.com

(18)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
办公地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
法定代表人:陈柏青
联系人:傅盛
客服电话:95188
网址:www.antfund.com

(19)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路Halo广场4楼
法定代表人:薛峰
联系人:董彩芹
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn

(20)阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街12号昆泰国际大厦11号楼12层
法定代表人:李科
联系人:杨舒
客服电话:95510
网址:life.sinosig.com

(21)华泰期货有限公司
注册地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层
办公地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层
法定代表人:吴祖芳
联系人:马丹
客服电话:4006280888
网址:www.htfc.com

(22)深圳新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦2层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富都大厦16层
法定代表人:洪弘
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
网址:http://8j.com.cn/

(23)北京北方基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村e世界E世界A座1108室
法定代表人:王伟刚
联系人:于伟
客服电话:400-619-9059
网址:www.bfj.com.cn

(24)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞鹿路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区区长路1687号2号楼
法定代表人:汪静波
联系人:李婧
客服电话:400-821-5399
网址:https://www.noah-fund.com/

(25)江苏天鼎证券投资咨询有限公司
注册地址:南京市秦淮区太平南路389号1002室
办公地址:江苏省南京市鼓楼区平安里74号
法定代表人:金静婷
联系人:黄丹韵
客服电话:025-962155
网址:www.tdzt88.com

(26)上海煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
联系人:李美涛
客服电话:4008205369
公司网址:www.yufund.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

二、登记机构

名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室
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
联系人:李国欣
客服电话:4008205369
公司网址:www.htsc.com.cn

(14)本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(16)本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

(17)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;基金在任何交易日终,持有的买入期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧算)占基金资产的80%-95%;

(18)基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;基金在任何交易日日内,持有的买入国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(19)基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(20)本基金投资受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(21)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(22)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(23)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(24)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第(2)、(12)、(22)、(23)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金投资比例不符合上述规定比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
执行事务合伙人:邵俊
联系电话:(010)85805000
传真:(010)85185111
联系人:钱茹菱
经办注册会计师:张楠 钱茹菱

第四部分 基金的简介

基金名称:华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金
基金类型:股票型证券投资基金
运作方式:契约型开放式、发起式

第五部分 基金的投资

一、投资目标
本基金通过量化选股模型精选股票,在有效控制风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。

二、投资范围
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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可根据投资适当程序,可以将其纳入投资范围。

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所保证金后,应当保持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。

三、投资策略
本基金是一只采取主动管理投资模式的股票基金。在投资策略上,管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置,然后充分利用量化模型,先将原始行业数据进行深层次的加工、计算,建立各个行业的分析逻辑,再通过模型构建,建立因子分析框架,然后挖掘数据形成因子,通过因子拟合趋势,进行回测和验证,从而挖掘出不同行业的敏感因子,提取合成不同行业的观察指标,结合管理人线下的研究进行行业轮动的因子选择,构建合理的投资组合。

1.资产配置策略
本基金通过定性定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票类资产和债券类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各个关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险收益特征进行预测,根据上述定性定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产 投资权重,实现资产合理配置。

2.股票投资策略
本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,精选个股构建投资组合,以追求超越业绩比较基准的业绩水平。在实际运行过程中,将定期或不定期进行修正,优化投资组合表现。本基金采用的量化投资策略主要有:

(1)多因子选股模型:多因子选股模型由本基金管理人根据中资资本市场的实际情况开发的具有针对性和实用性的数量化选股模型。模型首先综合考虑经济因素、流动性因素、行业发展趋势等大的市场环境,其次细致评估个股的估值情况、成长情况、动量、成交量、行为情况等多维度筛选。模型按照多因子,并经过数量化模型进行排序,选出符合模型的个股组成一篮子投资组合,并定期更新投资组合;

(2)事件驱动模型:通过研究发现,有较多事件驱动策略在中国A股市场有效或阶段性有效。如一致预期驱动策略,上市公司业绩超预期市场预期策略,管理层增持