华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（华夏创业板200ETF发起式联接A）基金产品资料概要更新

编制日期:2026年6月12日

送出日期:2026年6月15日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。

作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	华夏创业板200ETF发起式联接	基金代码	020837
下属基金简称	华夏创业板200ETF发起式联接A	下属基金代码	020837
基金管理人	华夏基金管理有限公司	基金托管人	广发证券股份有限公司
基金合同生效日	2024-03-05		
基金类型	基金中基金	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	刘蔚	开始担任本基金基金经理的日期	2026-01-16
		证券从业日期	2019-07-01
其他	《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,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延续基金合同期限。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

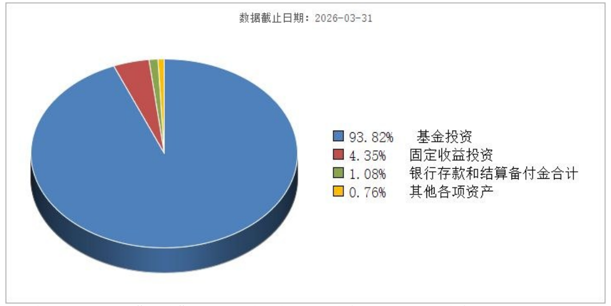
投资目标	通过对目标ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资范围	本基金的标的指数为创业板200指数。本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股(含存托凭证、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	主要投资策略包括目标ETF投资策略,股票投资策略,存托凭证投资策略,债券投资策略,衍生品投资策略,资产支持证券投资策略,可转换债券、可交换债券投资策略,参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	创业板200指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

注:①投资者请认真阅读《招募说明书》"基金的投资"章节了解详细情况。

②根据2017年施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级,基金的风险收益特征不代表基金的风险评级,具体风险评级结果参见基金管理人、销售机构提供的评级结果。

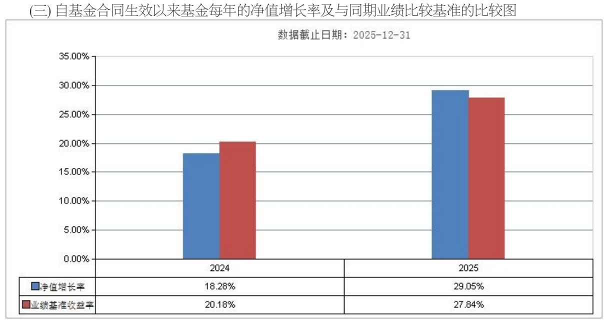
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



注:图示比例为定期报告期末基金投资组合中各类资产金额占基金总资产的比例。

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注:①本基金合同于2024年3月5日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

②基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)	M < 100万元	1.20%	–
	100万元 <= M < 200万元	0.90%	–
	200万元 <= M < 500万元	0.60%	–
	M >= 500万元	1000元/笔	–
赎回费	N < 7天	1.50%	–
	N >= 7天	0.00%	–

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率或金额	收费方
管理费	按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的年费率计提。0.15%	基金管理人、销售机构
托管费	按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的年费率计提。0.05%	基金托管人
审计费用	年费用金额(元)7,900.00	会计师事务所
信息披露费	年费用金额(元)50,000.00	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。	相关服务机构

注:①本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

②管理费、托管费为最新合同费率。

③审计费用、信息披露费用为由基金整体承担的年费用金额,非单个份额类别费用。上表年费用金额为产品资料概要更新编制日所在年度的当年度初始预估年费用金额,非实际产生费用金额,实际由基金资产承担的审计费和信息披露费可能与预估值存在差异,最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额,在持有期间,投资者需支出的运作费率如下表:

基金运作综合费率(年化)
0.39%

注:①基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率(若有)+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例(年化),以百分比形式列示,保留到小数点后2位。基金运作综合费用包含由基金资产承担的费用,如管理费、托管费、销售服务费(若有)、审计费用、信息披露费、银行间账户维护费、银行汇划费等费用,不包括基金交易产生的证券交易费用、税金及附加、信用减值损失(若有)等。审计费用、信息披露费、银行间账户维护费、银行汇划费等其他运作费用,根据最近一次基金年报披露的其他费用金额,除以基金每日平均资产净值计算年费率。基金每日平均资产净值=基金每日资产净值合计/当年天数(保留两位小数,按当年自然天数计算,当年成立的基金,按当年实际运作天数计算)。

②基金管理费率、托管费率、销售服务费率(若有)为基金现行费率,其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

③其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例(年化)系根据历史数据测算,计算结果受基金日均规模影响,实际年化费率与测算数据可能存在差异,敬请投资者留意。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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,联接基金风险,跟踪偏离风险,与目标ETF业绩差异的风险,指数编制机构停止服务的风险,标的指数变更的风险,成份股停牌或退市的风险,流动性风险,资产支持证券投资风险,参与转融通证券出借业务的风险,衍生品投资风险,操作或技术风险,政策变更风险,存托凭证投资风险,基金合同自动终止的风险,本基金的其他特定风险等。

本基金为ETF联接基金,基金资产主要投资于目标ETF,在多数情况下将维持较高的目标ETF投资比例,基金净值可能会随目标ETF的净值波动而波动,目标ETF的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金为发起式基金,发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于人民币1000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年,法律法规和监管机构另有规定的除外。《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,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延续基金合同期限。故投资者将面临基金合同终止的风险。

本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人可能依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,暂停披露侧袋账户份额净值,不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性,并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值,基金份额持有人可能因此面临损失。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准,并不表明其对本基金的价值和收益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。

基金的过往业绩不代表未来表现。

基金销售相关费用中的认购/申购金额含认购/申购费。

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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

基金投资人请认真阅读基金合同的争议处理相关章节,充分了解本基金争议处理的相关事项。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.ChinaAMC.com][400-818-6666]:

1、基金合同、托管协议、招募说明书

2、定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（华夏创业板200ETF发起式联接C）基金产品资料概要更新

编制日期:2026年6月12日

送出日期:2026年6月15日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。

作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	华夏创业板200ETF发起式联接	基金代码	020837
下属基金简称	华夏创业板200ETF发起式联接C	下属基金代码	020838
基金管理人	华夏基金管理有限公司	基金托管人	广发证券股份有限公司
基金合同生效日	2024-03-05		
基金类型	基金中基金	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	刘蔚	开始担任本基金基金经理的日期	2026-01-16
		证券从业日期	2019-07-01
其他	《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,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延续基金合同期限。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

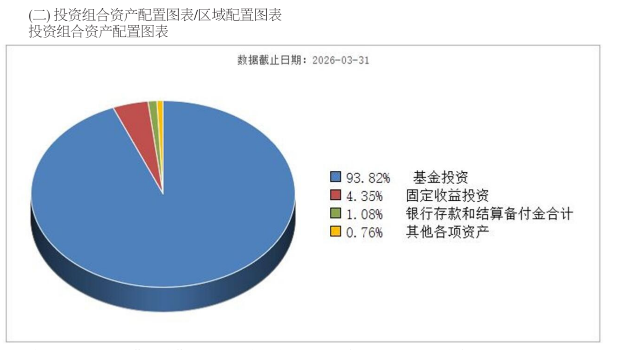
投资目标	通过对目标ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资范围	本基金的标的指数为创业板200指数。本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股(含存托凭证、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在1年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	主要投资策略包括目标ETF投资策略,股票投资策略,存托凭证投资策略,债券投资策略,衍生品投资策略,资产支持证券投资策略,可转换债券、可交换债券投资策略,参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	创业板200指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

注:①投资者请认真阅读《招募说明书》"基金的投资"章节了解详细情况。

②根据2017年施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级,基金的风险收益特征不代表基金的风险评级,具体风险评级结果参见基金管理人、销售机构提供的评级结果。

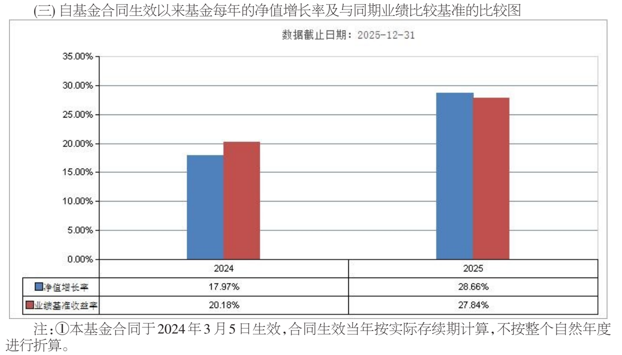
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



注:图示比例为定期报告期末基金投资组合中各类资产金额占基金总资产的比例。

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注:①本基金合同于2024年3月5日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

②基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7天	1.50%	–
	N >= 7天	0.00%	–

注:投资者选择认购/申购C类基金份额的,不收取认购费/申购费,从基金资产中计提销售服务费。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率或金额	收费方
管理费	按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的年费率计提。0.15%	基金管理人、销售机构
托管费	按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的年费率计提。0.05%	基金托管人
销售服务费	固定费率0.30%	销售机构
审计费用	年费用金额(元)7,900.00	会计师事务所
信息披露费	年费用金额(元)50,000.00	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。	相关服务机构

注:①本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

②管理费、托管费为最新合同费率。

③审计费用、信息披露费用为由基金整体承担的年费用金额,非单个份额类别费用。上表年费用金额为产品资料概要更新编制日所在年度的当年度初始预估年费用金额,非实际产生费用金额,实际由基金资产承担的审计费和信息披露费可能与预估值存在差异,最终实际金额以基金定期报告披露为准。

④销售服务费为最新合同费率,不含费率优惠。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额,在持有期间,投资者需支出的运作费率如下表:

基金运作综合费率(年化)
0.69%

注:①基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率(若有)+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例(年化),以百分比形式列示,保留到小数点后2位。基金运作综合费用包含由基金资产承担的费用,如管理费、托管费、销售服务费(若有)、审计费用、信息披露费、银行间账户维护费、银行汇划费等费用,不包括基金交易产生的证券交易费用、税金及附加、信用减值损失(若有)等。审计费用、信息披露费、银行间账户维护费、银行汇划费等其他运作费用,根据最近一次基金年报披露的其他费用金额,除以基金每日平均资产净值计算年费率。基金每日平均资产净值=基金每日资产净值合计/当年天数(保留两位小数,按当年自然天数计算,当年成立的基金,按当年实际运作天数计算)。

②基金管理费率、托管费率、销售服务费率(若有)为基金现行费率,其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

③其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例(年化)系根据历史数据测算,计算结果受基金日均规模影响,实际年化费率与测算数据可能存在差异,敬请投资者留意。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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,联接基金风险,跟踪偏离风险,与目标ETF业绩差异的风险,指数编制机构停止服务的风险,标的指数变更的风险,成份股停牌或退市的风险,流动性风险,资产支持证券投资风险,参与转融通证券出借业务的风险,衍生品投资风险,操作或技术风险,政策变更风险,存托凭证投资风险,基金合同自动终止的风险,本基金的其他特定风险等。

本基金为ETF联接基金,基金资产主要投资于目标ETF,在多数情况下将维持较高的目标ETF投资比例,基金净值可能会随目标ETF的净值波动而波动,目标ETF的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金为发起式基金,发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于人民币1000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年,法律法规和监管机构另有规定的除外。《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,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延续基金合同期限。故投资者将面临基金合同终止的风险。

本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人可能依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,暂停披露侧袋账户份额净值,不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性,并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值,基金份额持有人可能因此面临损失。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准,并不表明其对本基金的价值和收益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。

基金的过往业绩不代表未来表现。

基金销售相关费用中的认购/申购金额含认购/申购费。

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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

基金投资人请认真阅读基金合同的争议处理相关章节,充分了解本基金争议处理的相关事项。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.ChinaAMC.com][400-818-6666]:

1、基金合同、托管协议、招募说明书

2、定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书(更新)

2026年6月15日公告

基金管理人:华夏基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

重要提示

华夏创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称"本基金")经中国证监会2024年1月22日证监许可【2024】148号文准予注册。本基金基金合同于2024年3月5日正式生效。根据基金管理人于2026年6月15日刊登的《华夏基金管理有限公司关于变更华夏创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金名称并修订基金合同的公告》,"华夏创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金"自2026年6月15日起更名为"华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金"。

基金管理人保证本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和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的管理风险,本基金的特定风险等。本基金为华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"华夏创业板200ETF")的联接基金,主要通过投资华夏创业板200ETF紧密跟踪标的指数的表现,因此本基金的净值会因华夏创业板200ETF净值波动而产生波动。本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险。本基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》,基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级,风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征,但由于风险分类标准的变化,本基金的风险等级表述可能有相应变化,具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金可投资于资产支持证券,可能面临的风险包括流动性风险、证券提前赎回风险、再投资风险和SPV违约风险等。本基金可投资于股票期权、股指期货、国债期货等金融衍生品,可能面临的风险包括市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、操作风险等。本基金可参与转融通证券出借业务,面临的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等。

本基金为发起式基金,发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于人民币1000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年,法律法规和监管机构另有规定的除外。《基金合同》生效之日起三年后的年度对应日,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延续基金合同期限。故投资者将面临基金合同终止的风险。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人可能依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,暂停披露侧袋账户份额净值,不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性,并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值,基金份额持有人可能因此面临损失。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。投资者应当认真阅读并完全理解基金合同第二十部分规定的免责条款、第二十一部分规定的争议处理方式。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

投资者应当认真阅读并完全理解基金合同规定的免责条款和规定的争议处理方式。

本招募说明书更新有关财务数据和净值表现数据截止日为2026年3月31日,主要人员情况截止日为2026年6月12日。(本招募说明书中的财务资料未经审计)

本次更新事项:因指数更名变更基金名称并修订基金合同,修订内容自2026年6月15日起生效。

一、绪言

《华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书(更新)》依据《中华人民共和国证券法》(以下简称"《证券法》")、《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销售机构监督管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《公开募集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"《流动性风险管理规定》")、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称"《指数基金指引》")及其他有关规定以及《华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额,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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《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。

二、释义

本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义

1、基金或本基金:指华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

2、目标ETF:另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金(简称ETF),该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同,并且,该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似,本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金以华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF。

3、ETF联接基金:是指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金。

4、基金管理人:指华夏基金管理有限公司。

5、基金托管人:指广发证券股份有限公司。

6、基金合同、《基金合同》:指《华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充。

7、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充。

8、招募说明书或本招募说明书:指《华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新。

9、基金产品资料概要:《华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新。

10、基金份额发售公告:指《华夏创业板中盘200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额发售公告》。

11、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。

12、《基金法》:指《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。

13、《销售办法》:指《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

14、《信息披露办法》:指《公开募集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。

15、《运作办法》:指《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。

16、《流动性风险管理规定》: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。

17、《指数基金指引》:指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订。

18、中国证监会:指中国证券监督管理委员会。

19、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构。

20、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。

21、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。

22、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。

23、合格境外投资者:指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以使用来自境外的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,包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

24、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外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。

25、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。

26、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。

27、销售机构:指华夏基金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代理协议,代为办理基金销售业务的机构。

28、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。

29、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华夏基金管理有限公司或接受华夏基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。

30、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、由该登记机构登记的基金份额余额及其变动情况的账户。

31、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而引起的基金份额变动及结余情况的账户。

32、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。

33、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。

34、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3个月。

35、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限。

36、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

37、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。

38、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)。

39、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。

40、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。

41、《业务规则》:指《华夏基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守。

42、认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为。

43、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。

44、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。

45、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。

46、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。

47、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。

48、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%。

49、元:指人民币元。

50、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。

51、基金资产总值:指基金拥有的目标ETF份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

52、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值。

53、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数。

54、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。

55、规定媒介:指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介。

56、销售服务费:指从基金财产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用。

57、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。

58、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,确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待。

59、转融通证券出借业务:指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称证券金融公司)出借证券,证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。

60、侧袋机制:指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算,目的在于有效隔离并化解风险,确保投资者得到公平对待,属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间,原有账户称为主袋账户,专门账户称为侧袋账户。

61、特定资产:包括:(一)无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产;(二)按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产;(三)其他资产价值存在重大不确定性的资产。

62、发起式基金:指符合《运作办法》和中国证监会规定的相关条件募集、运作,由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理(指基金管理人员工中具有基金经理资格者,包括但不限于本基金的基金经理,下同)等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金。

63、发起资金:指用于认购发起式基金且来源于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(指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者,包括但可能不限于本基金的基金经理,下同)等人员的资金。

64、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。

65、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。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:华夏基金管理有限公司

住所:北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址:北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层

设立日期:1998年4月9日

法定代表人:邹迎光

联系人:邱曦

客户服务电话:400-818-6666

传真:010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为23800万元,公司股权结构如下:

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
Mackenzie Financial Corporation	27.8%
Qatar Holding LLC	10%
合计	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、经理及其他高级管理人员基本情况

邹迎光先生:董事长,党委书记,硕士。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员。曾任中信建投债券业务部总经理助理、固定收益部行政负责人、执行委员会委员,中信证券固定收益部行政负责人、执行委员、党委委员,中信建投党委委员、执行董事、执行委员会委员、财务负责人。

李一梅女士:副董事长,党委副书记,总经理,硕士。兼任华夏基金(香港)有限公司董事长、华夏股权投资基金管理(北京)有限公司董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理、数据中心行政负责人(兼),上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理,证通股份有限公司董事等。

侯薇薇女士:董事,学士。现任鲍尔太平有限公司(Power Pacific Corporation Ltd)总裁兼首席执行官,兼任加中贸易理事会国际董事会成员。曾任嘉实国际资产管理公司(HGI)的全球管理委员会成员、首席业务发展官和中国战略负责人等。

J Luke Gregoire Gould先生:董事,学士。现任迈凯希金融公司(Mackenzie Financial Corporation)总裁兼首席执行官。曾任IGM Financial Inc.的执行副总裁兼首席财务官、Mackenzie Investments的首席财务官、Investors Group的高级副总裁兼首席财务官等。

陈颖行先生:董事,硕士。现任卡塔尔投资局咨询(亚太)公司大中华区总监。曾任中国投资有限责任公司投资二部团队负责人,都铎资本(新加坡)公司分析师,BP新加坡公司量化分析师,渣打银行(新加坡)有限公司风险分析师等。

史本良先生:董事,硕士,注册会计师。现任中信证券股份有限公司党委委员、执行委员、财富管理委员会主任、战略客户部行政负责人。曾任中信证券股份有限公司计划财务部资产管理业务核算会计主管、联席负责人、行政负责人,中信证券财务负责人等。

薛继锐先生:董事,博士。现任中信证券股份有限公司执行委员。曾任中信证券股份有限公司金融产品开发小组经理、研究部研究员、交易与衍生产品业务线产品开发组负责人、股权衍生品业务线行政负责人、证券金融业务线行政负责人、权益投资部行政负责人等。

刘霞辉先生:独立董事,硕士。现任中国社会科学院经济研究所国务院特殊津贴专家,二级研究员,博士生导师。兼任中国战略研究会经济战略专业委员会主任、山东大学经济社会研究院特聘兼职教授及广西南宁政府咨询专家。曾任职于国家人社部政策法规司综合处。

殷少平先生:独立董事,博士。现任中国人民大学法学院副教授、硕士生导师,兼任北京凯因科技股份有限公司非执行董事。曾任最高人民法院民事审判第三庭审判员、高级法官,湖南省株洲市中级人民法院副院长、审判委员会委员,北京同仁堂股份有限公司、河北太行水泥股份有限公司独立董事,广西壮族自治区南宁市西乡塘区政府副区长,北京市地石律师事务所兼职律师等。

伊志宏女士:独立董事,博士。教授,博士生导师,主要研究方向为财务管理、资本市场。曾任中国人民大学副校长,中国人民大学商学院院长,中国人民大学中法学院院长,享受国务院政府特殊津贴。兼任国务院学位委员会第七届、第八届工商管理学科评议组召集人、第五届、第六届全国MBA教育指导委员会副主任委员、教育部工商管理专业教学指导委员会副主任委员、西班牙IE大学国际顾问委员会委员。曾兼任中国金融会计学会副会长、欧洲管理发展基金会(EFMD)理事会理事、国际高等商学院协会(AACSB)首次认证委员会委员等。

何青女士:独立董事,硕士。曾任长城证券股份有限公司副总经理,华能天成融资租赁有限公司副总经理,中国华能财务有限责任公司副总经理、总经理助理和部门经理等职务。

王芬华女士:职工代表董事,学士。现任华夏基金管理有限公司党委组织部部长、人力资源部行政负责人。曾任华夏基金管理有限公司人力资源部副总经理、总经理助理等职务。

刘义先生:副总经理,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员,中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长(主持工作),华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监,华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生:副总经理、投资总监,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员,兼任华夏基金(香港)有限公司副董事长。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理,宝盈基金管理有限公司基金经理助理,益民基金管理有限公司投资部部门经理,华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

郑煜女士:副总经理,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委副书记。曾任华夏证券高级分析师,大成基金高级分析师、投资经理,原中信基金股权投资部总监,华夏基金管理有限公司总经理助理、纪委书记等。

孙彬先生:副总经理,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、投资经理等。曾任华夏基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理、公司总经理助理等。

张德根先生:副总经理,硕士。曾任职于北京新财经杂志社、长城证券,曾任华夏基金管理有限公司深圳分公司总经理助理、副总经理、总经理,广州分公司总经理,上海华夏财富投资管理有限公司副总经理,华夏基金管理有限公司总经理助理、研究发展部行政负责人(兼)、北京分公司总经理(兼)等。

李彬女士:督察长,硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、纪委书记、法律部行政负责人(兼)。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理,法律监察部副总经理、联席负责人,合规部行政负责人等。

孙立强先生:财务负责人,硕士。现兼任华夏基金(香港)有限公司董事。曾任职于深圳航空有限责任公司计划财务部,曾任华夏基金管理有限公司基金运作部B角、财务部行政负责人,华夏资本管理有限公司监事、上海华夏财富投资管理有限公司监事等。

桂勇先生:首席信息官,学士。兼任华夏基金管理有限公司金融科技部行政负责人。曾任职于深圳市长城光纤网络有限公司、深圳市中大投资管理有限公司,曾任中信基金管理有限责任公司信息技术部负责人,华夏基金管理有限公司信息技术部总经理助理、副总经理、行政负责人等。

2、本基金基金经理

刘蔚先生,硕士。2019年7月加入华夏基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,现任华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2026年1月16日起任职)、华夏创业板200交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年1月16日起任职)、华夏国证石油天然气交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年3月11日起任职)、华夏中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年3月11日起任职)、华夏中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年4月1日起任职)、华夏中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年4月16日起任职)、华夏国证大盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年4月29日起任职)、华夏中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年5月15日起任职)、华夏中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年6月11日起任职)、华夏创业板50交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年6月11日起任职)、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2026年6月11日起任职)、华夏中证浙江国资创新发展交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年6月11日起任职)、华夏中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2026年6月11日起任职)、华夏中证装备产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(2026年6月11日起任职)。

历任基金经理:2024年3月5日至2026年1月16日期间,华龙先生任基金经理。

3、本公司量化投资决策委员会成员

主任:徐猛先生,华夏基金管理有限公司数量投资部行政负责人,基金经理。

成员:阳琨先生,华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监,基金经理。

张德根先生,华夏基金管理有限公司副总经理。

孙蒙先生,华夏基金管理有限公司数量投资部总监,基金经理。

荣膺女士,华夏基金管理有限公司数量投资部B角,基金经理。

袁英杰先生,华夏基金管理有限公司数量投资部总监,基金经理、投资经理。

赵宗庭先生,华夏基金管理有限公司数量投资部总监,基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、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、编制季度报告、中期报告和年度报告。

7、计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回对价。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(四)基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并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。

3、本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)向其基金管理人、基金托管人出资;

(5)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

4、本基金管理人将加强人员管理,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,不从事以下行为:

(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,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

5、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利益。

(2)不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(五)基金管理人的内部控制制度

基金管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、内部监控等要素。公司已经通过了ISAE3402(《鉴证业务国际准则第3402号》)认证,获得无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告。

1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

(1)公司引入了独立董事制度。董事会下设审计委员会等专门委员会。公司管理层设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

(2)公司各部门之间有明确的授权分工,既互相合作,又互相核对和制衡,形成了合理的组织结构。

(3)公司坚持稳健经营和规范运作,重视员工的合规守法意识和职业道德的培养,并进行持续教育。

2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后,对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险,风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务;对于可控风险,风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度,以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

3、控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上,做到了业务操作流程的科学、合理和标准化,并要求完整的记录、保存和严格的检查、复核;在岗位责任制度上,内部岗位分工合理、职责明确,不相容的职务、岗位分离设置,相互检查、相互制约。

(1)投资控制制度

投资决策委员会是公司的最高投资决策机构,负责资产配置和重大投资决策等;基金经理小组负责在投资决策委员会资产配置基础上进行组合构建,基金经理领导基金经理小组在基金合同和投资决策权限范围内进行日常投资运作;交易管理部负责所有交易的集中执行。

①投资决策与执行相分离。投资管理决策职能和交易执行职能严格隔离,实行集中交易制度,建立和完善公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

②投资授权控制。建立明确的投资决策授权制度,防止越权决策。投资决策委员会负责制定投资原则并审定资产配置比例;基金经理小组在投资决策委员会确定的范围内,负责确定与实施投资策略、建立和调整投资组合并下达投资指令,对于超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;交易管理部依据基金经理或基金经理授权的小组成员的指令负责交易执行。

③警示性控制。按照法规或公司规定设置各类资产投资比例的预警线,交易系统在投资比例达到接近限制比例前的某一数值时自动预警。

④禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定,基金禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。交易系统通过预先的设定,对上述禁止进行自动提示和限制。

⑤多重监控和反馈。交易管理部对投资行为进行一线监控;风险管理部进行事中的监控;监察稽核部门进行事后的监控。在监控中如发现异常情况将及时反馈并督促调整。

(2)会计控制制度

①建立了基金会计的工作制度及相应的操作和控制规程,确保会计业务有章可循。

②按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管人相关业务的相互核查监督制度。

③为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度。

④制定了完善的档案保管和财务交接制度。

(3)技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行,公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

(4)人力资源管理制度

公司建立了科学的招聘解聘制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度,确保人力资源的有效管理。

(5)监察制度

公司设立了监察部门,负责公司的法律事务和监察工作。监察制度包括违规行为的调查程序和处理制度,以及对员工行为的监察。

(6)反洗钱制度

公司设立了反洗钱工作小组作为反洗钱工作的专门机构,指定专门人员负责反洗钱和反恐融资合规管理工作;各相关部门设立了反洗钱岗位,配备反洗钱负责人员。除建立健全反洗钱组织体系外,公司还制定了《反洗钱工作内部控制制度》及相关业务操作规程,确保依法切实履行金融机构反洗钱义务。

4、信息沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,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,信息及时送交适当的人员进行处理。目前公司业务均已做到了办公自动化,不同的人员根据其业务性质及层级具有不同的权限。

5、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的稽核部门,通过定期或不定期检查,评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司各项内部控制制度的执行情况,确保公司各项经营管理活动的有效运行。

6、基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司确知建立、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)上述关于内部控制的披露真实、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)基金托管人情况

1、基本情况

名称:广发证券股份有限公司(简称:广发证券)

住所:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址:广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

法定代表人:林传辉

成立时间:1994年1月21日

基金托管资格批文及文号:证监许可【2014】510号

注册资本:人民币7,824,845,511元

存续期间:长期

联系人:罗琦

联系电话:020-66338888

广发证券是国内首批综合类证券公司,先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市(股票代码:000776.SZ,1776.HK)。截至2025年12月31日,公司共设立证券营业部330家。

广发证券具有完备的业务体系、均衡的业务结构,突出的核心竞争力。拥有投资银行、财富管理、交易及机构和投资管理四大业务板块,具备全业务牌照。公司锻造综合金融服务实力,主要经营指标连续多年稳居中国券商前列,在多项核心业务领域中形成了领先优势,研究、资产管理、财富管理等业务位居前列。截至2025年12月31日,集团总资产9,754.84亿元,归属于上市公司股东的所有者权益为1,561.11亿元,2025年营业收入为354.93亿元,营业利润为187.93亿元,归属于上市公司股东的净利润为137.02亿元。

2、主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于2000年7月获得北京大学理学学士,并于2003年7月获得北京大学经济学硕士学位。

广发证券资产托管部主要人员均具备多年基金、证券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验,从业经验丰富,具备基金从业资格,熟悉基金托管工作。资产托管部员工学历均在本科以上,专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域,是一支诚实勤勉、积极进取的专业从业人员队伍。

3、基金托管业务经营情况

广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责,不断加强风险管理和内部控制,确保基金资产的完整性和独立性,切实维护基金份额持有人的合法权益,提供高质量的基金托管服务。截至2025年12月31日,广发证券托管的公开募集证券投资基金共117只。

(二)基金托管人的风险管理原则和内部控制制度

广发证券开展基金托管业务遵循以下风险管理原则:

1、合规性原则。保持风险管理政策与监管部门要求相一致,并把监管规定作为业务开展和风险管理应遵从的最基本要求。

2、全面性原则。资产托管业务风险管理应涵盖可能出现的所有风险类型,应渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节,风险控制应落实到业务涉及的所有岗位、所有环节,包含事前风险控制、事中风险监控、事后风险报告和处理。

3、制衡性原则。资产托管业务各级业务部门和岗位的设置应当权责分明、相互制约,建立不同部门、不同岗位之间的制衡体系。

4、独立性原则。公司的风险控制相关部门,包括合规与法律事务部、风险管理部、稽核部等,均应保持高度的独立性,各自从独立的风险控制角度出发,对资产托管业务的风险进行管理。

5、持续性原则。公司对资产托管业务开展持续的风险管理工作,根据实际情况动态调整风控措施和风控手段,并通过顺畅的风险报告和传导机制,及时有效地处理各种风险事项,确保风险管理政策和措施的贯彻实施。

广发证券根据相关法律法规和公司制度的相关要求,制定了完善的内部控制制度,具体包括《广发证券资产托管业务管理办法》、《广发证券资产托管业务信息披露管理规定》、《广发证券资产托管业务账户管理规定》、《广发证券资产托管产品估值核算管理规定》、《广发证券资产托管业务资金清算管理规定》、《广发证券公募基金投资监督管理规定》、《广发证券资产托管部业务信息保密与业务档案管理规定》、《广发证券资产托管业务应急管理规定》、《广发证券资产托管部工作人员管理规定》、《广发证券股份有限公司资产托管业务公开募集证券投资基金风险准备金管理规定》等,囊括了基金托管业务的账户管理、估值核算、资金清算、投资监督、内部控制、风险管理、业务系统管理、保密和档案管理、应急处理、从业人员管理等全部业务环节。

(三)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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规规定以及基金合同、基金托管协议相关约定,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、信息披露等进行监督。

基金托管人发现基金管理人违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规规定或基金合同、基金托管协议相关约定的行为,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)销售机构

1、直销机构

名称:华夏基金管理有限公司

住所:北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址:北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层

法定代表人:邹迎光

客户服务电话:400-818-6666

传真:010-63136700

联系人:张德根

网址:www.ChinaAMC.com

2、代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:廖林

传真:010-66107914

联系人:赵亮

网址:www.icbc.com.cn

客户服务电话:95588

(下转D3版)