

华润元大量化优选混合型证券投资基金招募说明书(更新)

(2020年第1号)

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二〇二〇年二月

【重要提示】
华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金经2014年5月12日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]472号文核准募集注册,《华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金合同》于2014年8月18日正式生效。依据2014年8月8日颁布实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定,华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金于2015年8月3日变更基金类型,由股票型基金变更为混合型基金,基金合同中相应条款亦进行相应修订,并于2018年9月17日经中国证监会证监许可[2018]1499号文准予变更注册为华润元大量化优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)。

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。

投资者有风险,投资有风险。投资者在认购本基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同,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。本基金面临的主要风险是市场风险、流动性风险、信用风险、政策风险、管理风险、操作风险、技术风险、合规性风险及基金的特有风险等。本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。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,本基金管理人不对投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的成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,由投资者自行承担。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市股票的(以下简称“港股通标的股票”)或选择将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必然投资港股通标的股票。基金资产投资港股通标的股票可能使本基金面临港股通交易机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,具体详见本招募说明书中“基金的风险揭示”章节。

本基金主要投资于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、港股通标的股票、一级市场新股或增发的股票、债券、货币市场工具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的相关规定),在正常市场环境下本基金资产的流动性风险适中。在特殊市场条件下,如证券市场成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下,可能导致基金资产变现困难或变现时证券资产价格出现较大波动,发生基金份额净值波动幅度较大,无法进行正常赎回款项支付,基金不能实现既定的投资目标等风险。

本基金采用量化模型仅用于选股,并不基于量化模型进行频繁交易,在实际运作过程中,存在因量化模型失效而导致基金亏损的风险。

一、基金合同生效日期

2014年8月18日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:华润元大基金管理有限公司

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层

邮政编码:518048

法定代表人:邹新

成立时间:2013年1月17日

注册资本:6亿元人民币

存续期间:永续经营

联系人:林婧婷

电话:(0755)88399008

传真:(0755)88399045

华润元大基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会证监许可[2012]

1746号文批准设立,经中国证监会证监许可[2019]1629号文批准增加注册资本并变更百分之五以上股权股东。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
华润润国信托有限公司	51%
元大证券投资信托股份有限公司	24.5%
华润金控投资有限公司	24.5%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资人的合法权益。公司董事会下设两个专业委员会:薪酬与提名委员会、风险控制委员会,有针对性地对公司在经营管理和基金运作中的相关情况,制定相应的政策,并充分发挥独立董事的职能,切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由四位监事组成,主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司实行董事会领导下的总经理负责制,总经理根据公司章程及董事会授权,全面主持公司日常经营管理。督察长负责公司及基金运作的监察稽核工作,由公司董事会聘任,对董事会负责。公司经营层设总经理业务办公会、产品审议委员会、风险管理委员会、金融科技委员会、公募基金投资决策委员会、专户产品投资决策委员会,固有资金投资运用管理委员会作为总经理行使职权的议事决策机构。

公司按照不同业务职能,分为十六个部门,其中投研包括投资管理部、量化指数部、专户投资部、研究部和交易部五个部门;市场包括市场策划部、战略客户部、华南营销中心、华东营销中心和华北营销中心五个部门;运营包括信息技术部、运营管理部两个部门;同时公司还设立了综合管理部、财务部、风险管理部、合规管理部四个部门;风险管理部和合规管理部负责对公司及基金投资运作、内部管理等事项进行事前、事中、事后独立监督。

截至到2020年2月25日,公司有员工54人,其中58%的员工具有硕士及以上学历,96%的员工具有基金从业资格。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、监察稽核制度、基金会计制度、财务管理制度、信息技术管理制度、信息披露制度等公司管理制度。

(二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

李巍巍先生,董事长,博士学位。历任广州浪奇董事会秘书处主管、主任,国信证券总裁室主任秘书、人力资源部副总经理、总监,华西证券人力资源部、副总裁,华润润国信托有限公司副总经理。现任华润金控控股有限公司副总经理,华润投资控股(深圳)有限公司董事长、华润租赁有限公司董事。

郭庆卫先生,董事,硕士学位。历任中国人民银行总行货币发行司干部;中国光大银行总行业务经理、副处长、处长,第三届监事会职工监事,总行资产保全部总经理助理,深圳分行风险总监(副行长),总行资产保全部副总经理,总行法律合规部副总经理,中国民生信托有限公司副总裁,四川省国际信托投资公司重组工作组组长。现任华润润国信托投资有限公司副总经理。

刘宗圣先生,董事,博士学位。历任泰康WALL RESEARCH投资策略分析师、宝来证券研发部总经研究组组长、宝来证券基金总裁特别助理、总经理助理,国际金融部副总经理,宝来证券(香港)有限公司总经理,宝来证券投资信托股份有限公司总经理,PT AMCI Manajemen Investasi Indonesia 公司(简称AMII资产管理公司)董事(Commissioner)。现任元大证券投资信托股份有限公司董事长,元大资产管理公司(印度尼西亚)监事。

刘民先生,独立董事,博士学位。历任香港中文大学系统工程和工程管理系统助理教授、金融系助理教授、副教授,美国密苏里大学经济学系副教授、香港中文大学金融理学硕士项目主任、香港中文大学—清华大学MBA项目主任,现任深圳前海金融研究院执行副院长、教授,四川金天顺股份有限公司董事长,湖北省资产管理公司董事,深圳恒裕控股有限公司董事、深圳润国生态股份有限公司独立董事。

汪习刚先生,独立董事,博士学位。历任武汉大学法学院教授、博士生导师,现任华中科技大学法学院院长、教授。

秦军先生,独立董事,硕士研究生。历任中海地产总部人力资源部主管、经理,京基集团人力资源部经理,银华基金管理有限公司人力资源部负责人,信达澳银基金管理有限公司人力资源部及行政总监。现任珠海金融投资控股集团有限公司首席人力资源官,华金期货有限公司董事长、华金资产管理(深圳)有限公司副董事长、横琴华通金融租赁有限公司董事。

李仆先生,董事,总经理,硕士学位。历任宝钢集团及其下属各金融机构投资部门投资经理、副总经理,国收总监,信诚基金管理有限公司投资研究部基金经理,东方基金管理有限责任公司公司固收总监、投资总监、总经理助理,华润元大基金管理有限公司副总经理,深圳华润元大资产管理有限公司执行董事。

2、基金管理人监事会成员

卢伦女士,监事,硕士学位。历任华为技术有限公司人力资源部经理,晨星(深圳)资讯有限公司股票研究部研究员,华润(集团)有限公司财务部资本本副总监。现任华润润国信托有限公司财务总监。

黄昭棠先生,监事,硕士学位。历任宝来证券有限公司总经理室特别助理,宝来证券有限公司国际金融部经理,宝来证券(香港)有限公司营销总监,宝来证券投资信托股份有限公司指数投资中心执行长、元大证券投资信托股份有限公司指数暨量化投资事业群量化策略投资部资深副总经理、指数投研团队执行副总经理、投资长。现任元大证券投资信托股份有限公司总经理。

廖洁女士,监事,硕士学位。历任中国银行深圳市分行金融机构部证券岗、博时基金管理有限公司合规管理部法律顾问。现任华润元大基金管理有限公司合规管理部合规风控部副经理。

罗黎华先生,监事,硕士学位。历任安信证券股份有限公司国际业务部港股研究员、上海五牛股权投资管理有限公司风险管理及审计部助理总经理。现任华润元大资产管理有限公司投资管理部港股研究员,现任华润元大基金管理有限公司研究部高级研究员。

3、基金管理人高级管理人员

李巍巍先生,董事长,博士学位。简历见董事会成员介绍。

李仆先生,总经理,硕士学位。简历见董事会成员介绍。

刘豫皓先生,督察长,硕士学位。历任湖北省交通運輸厅汉十高速公路管理处职员,审计署西安特派员办事处主任科员,华润(集团)有限公司审计部高级审计师,华润金控控股有限公司风险管理及审计部助理总经理。现任华润元大基金管理有限公司督察长,深圳华润元大资产管理有限公司执行监事。

4、本基金基金经理

李武群先生,基金经理,中国科学院研究生院工学博士、10年金融行业从业经验。历任中信银行福州分行计划财务部统计岗,华西证券研究所量化高级研究员、股票投资部投资经理助理。2015年加入华润元大基金管理有限公司,现任华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大富时中国A50指数型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

李仆(总经理、基金经理)

金兴健(投研负责人、研究部负责人、专户投资部负责人)

刘宏毅(投资管理部负责人、基金经理)

李武群(量化指数部负责人、基金经理)

上述人员之间无近亲属关系。

三、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:周慕冰

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本:32,479.4117亿元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、

业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行(财富)世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(SAE3402)认证,表明了独立第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金牌理财”TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖、2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的“公募基金20年”“最佳基金托管银行”奖;2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近240名,其中具有高级职称的专家30余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2019年6月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共473只。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作,严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务的风险管理内部控制工作行使监督与评价;托管业务部下设资产风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施影像监控;业务信息以专机信息信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金投资监督的方法和程序
基金托管人通过投资设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:基金直销机构为本基金管理人直销中心。

名称:华润元大基金管理有限公司

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座7层

法定代表人:邹新

成立时间:2013年1月17日

电话:(0755)88399008

传真:(0755)88278943

联系人:黄欣欣

客户服务电话:4000-1000-89

网址:www.cryuanta-fund.com

2、代销机构

(1)中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街69号

法定代表人:周慕冰

联系人:张亚男

公司电话:010-66060069

客服电话:95598

官方网站:www.abchina.com

(2)珠海华润银行股份有限公司

住所:广东省珠海市吉大九洲大道东1346号

办公地址:广东省珠海市吉大九洲大道东1346号

法定代表人:刘晓勇

联系人:李阳

公司电话:0756-96588

客服电话:0756-96588

官方网站:www.crbank.com.cn

(3)平安银行股份有限公司

住所:广东省深圳市深南东路5047号

办公地址:广东省深圳市深南东路5047号

法定代表人:谢永林

联系人:赵杨

公司电话:0755-22166574

客服电话:95511-3

官方网站:bank.pingan.com

(4)招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路江苏大厦38—45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38—45层

法定代表人:霍达

联系人:黄婵君

公司电话:0755-82943666

客服电话:95565

官方网站:www.newone.com.cn

(5)中国银河证券股份有限公司

住所: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号国际企业大厦C座

法定代表人:陈共炎

联系人:李国欣

公司电话:010-83574507

客服电话:4008-888-888,95551

官方网站:www.chinastock.com.cn

(6)国信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

联系人:李丽

公司电话:0755-82130833

客服电话:95536

官方网站:www.guosen.com.cn

(7)东吴证券股份有限公司

住所:苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦

办公地址:苏州市工业园区星阳街5号东吴证券大厦

法定代表人:范力

联系人:郭晶晶

公司电话:0512-62938521

客服电话:95330

官方网站:www.dwzq.com.cn

(8)中信建投证券股份有限公司

住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳区朝内大街188号

法定代表人:王常青

联系人:刘杨

公司电话:010-85156398

客服电话:400-888-8108,95587

官方网站:www.cc108.com

(9)中信证券股份有限公司

住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层

法定代表人:张佑君

联系人:王一通

公司电话:010-60838888

客服电话:95548

官方网站:www.cs.ecitic.com

(10)中信证券(山东)有限责任公司

住所:青岛市市南区深圳路222号1号楼2001

办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人:姜晓林

联系人:刘晓明

公司电话:0531-89606165

客服电话:95548

官方网站:www.sd.citics.com

(11)兴业证券股份有限公司

住所:福州市湖东路268号

办公地址:上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人:高涛

联系人:乔燕燕

公司电话:021-38655547

客服电话:95562

官方网站:www.xyzq.com.cn

(12)中泰证券股份有限公司

住所:山东济南市中区经七路86号

办公地址:山东济南市中区经七路86号证券大厦2001室

法定代表人:李玮

联系人:许曼华

公司电话:021-20315290

客服电话:95538

官方网站:www.zts.com.cn

(13)光大证券股份有限公司