
汇安上证证券交易型开放式指数证券投资
基金
招募说明书（更新）摘要

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业证券股份有限公司

二〇二〇年五月

【重要提示】

1、本基金根据 2020 年 10 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2117 号）进行募集，本基金合同已于 2020 年 4 月 9 日生效。

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）基金的意愿、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/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，包括：市场风险、信用风险、操作风险、管理风险、合规风险、流动性风险、本基金的特有风险、基金管理人职责终止风险、其他风险等等。其中，同时由于本基金是交易型开放式指数基金，基金特有风险主要涵盖：指数化投资风险，包括标的指数波动的风险、标的指数的流动性风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险等；基金运作的特有风险，包括上市交易风险、基金份额二级市场交易价格折/溢价交易风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方服务机构的风险等等，具体请参见本招募说明书第十八部分风险揭示章节。

5、本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

6、投资者投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与网下

股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

7、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。

8、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。

9、根据法规要求，本基金管理人于 2020 年 4 月 30 日对招募说明书“第三部分基金管理人”、“第六部分基金的募集”及“第七部分基金合同的生效”的内容进行了更新。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：汇安基金管理有限责任公司（简称“汇安基金”）

住所：上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室

办公地址：北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

法定代表人：何斌(代行职务)

成立时间：2016 年 4 月 25 日

注册资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：赵庆玲

联系电话：（021）80219003

汇安基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2016]860 号文批准设立。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

何斌先生，董事长。22 年证券、基金行业从业经验。东北财经大学国民经济计划学学士，先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部，曾任国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司督察长、副总经理。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司董事长。

戴樱女士，董事。5 年证券、基金行业从业经验，2004 年毕业于上海对外贸易学院，国际贸易专业学士学位。曾就职于上海贝尔阿尔卡特股份有限公司，任采购部经理助理；上海樱琦干燥剂有限公司，任公司董事；上海上贝资产管理有限公司合伙人。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司金融机构部总经理。

刘强先生，董事。5 年证券、基金行业从业经验，美国注册管理会计师(CMA)，东北财经大学审计学学士。历任阿尔卡特深圳公司财务总监，霍尼韦尔深圳公司财务总监，阿特维斯（中国）财务及信息技术总监，北京刚正国际投资有限公司副总经理。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有

限责任公司副总经理。

李海涛先生，独立董事。美国耶鲁大学管理学院金融学博士。曾任密西根大学 Ross 商学院金融学教授、长江商学院金融学访问学者，现任长江商学院副院长及杰出院长讲习教授。

余剑峰先生，独立董事。2008 年毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院，金融学博士，教授学位。曾于 2014 秋任清华大学五道口金融学院访问教授；2015 年至 2016 年任香港中文大学（深圳）经管学院金融学教授、执行副院长；2008 年至 2017 年明尼苏达大学卡尔森管理学院金融学助理教授、副教授（终身教授）、正教授、Piper Jaffray 讲席教授；2016 年至今任清华大学五道口金融学院建树讲席教授；2017 年至今任清华大学国家金融研究院资产管理研究中心主任；2019 年至今任清华大学金融科技研究院副院长。

黄磊先生，独立董事。中国人民大学经济学博士，教授。曾任山东财经大学金融学院院长；曾任山东省政协、山东省政协常委、山东省政协经济组召集人、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员；曾任教育部金融类专业教学指导委员会委员。现任山东财经大学教授委员会主任委员、山东财经大学学术委员会副主任委员、区域金融优化与管理协同创新中心（山东）主任。

2、基金管理人监事

王丽英女士，监事。4 年证券、基金从业经验。毕业于中央财经大学会计学学士，2011 年 6 月至 2017 年 6 月在北京居然之家投资控股集团有限公司集团总部以及其名下子公司担任财务经理。2017 年 7 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司综合管理部副总监（财务）。

3、高级管理人员

何斌先生，董事长，代行总经理职务。（简历请参见董事会成员）

郭冬青先生，督察长。21 年证券、基金从业经验。南开大学经济学硕士。历任中石化集团财务部经济师、广发证券投行部高级经理、华安证券投行部副总经理、大商集团副总经理、中航证券董事总经理、北京国金鼎兴投资有限公司副总经理。2017 年 11 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司督察长。

窦星华先生，常务副总经理。14 年证券、基金从业经验，CFA。英国杜伦大学金融学硕士。历任标准普尔信息服务（北京）有限公司指数分析师，交银施罗

德基金管理有限公司产品经理，华安基金管理有限公司产品部总经理助理，盛世景资产管理股份有限公司产品总监。2016 年 7 月加入汇安基金管理有限责任公司任产品及创新业务部总经理，现任汇安基金管理有限责任公司常务副总经理。

刘强先生，副总经理。（简历请参见董事会成员）

郭兆强先生，副总经理。23 年证券、基金从业经验，保荐代表人。北京大学光华管理学院工商管理硕士。曾任山西证券投行部综合经理、中德证券高级副总裁，东北证券北京分公司深圳市场部副总经理，从事投资银行业务。2016 年 4 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

王俊波先生，副总经理。16 年证券、基金从业经验。中国人民大学金融学硕士。历任中国平安产险营销策划经理，嘉实基金券商业务部主管，兴业证券资产管理有限公司市场部执行总监。2016 年 7 月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

4、本基金拟任基金经理

朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，6 年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资事业部数量分析师、投资经理，从事量化投资研究工作。2017 年 12 月 29 日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2018 年 2 月 8 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 4 月 26 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 9 日至今，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 22 日至今，任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金；2019 年 3 月 13 日至今，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 14 日至今，任富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 30 日至今，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理。2019 年 12 月 24 日至今，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理。

陈欣，华东理工大学企业管理硕士。12 年证券、基金行业从业经历，曾任中银基金管理有限公司渠道经理，华安基金管理有限公司指数与量化事业部高级经理，从事指数与量化投资工作。2016 年 8 月 19 日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部总经理一职。2018 年 3 月 21 日至 2019 年 5 月 10 日，

任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年4月30日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2019年12月11日至今，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年5月20日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

何斌先生，董事长，代行总经理职务。（简历请参见董事会成员）。

钟敬棣先生，固定收益首席投资官。25年银行、基金行业从业经验，硕士。2005年4月加入嘉实基金，先后任固定收益研究员、投资经理。2008年5月加入建信基金，先后任基金经理、投资部副总监、固定收益首席投资官、公司投资决策委员会委员，曾管理建信稳定增利、双息红利、安心保本等债券型基金，多次被评为金牛基金。2018年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任固定收益首席投资官，董事总经理。

邹唯先生，首席投资官。20年证券、基金行业从业经历。理科硕士。历任长城证券有限公司研究部行业分析师，嘉实基金管理有限公司行业分析师、基金经理、主题策略组组长，中信产业基金金融投资部董事总经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司，现任首席投资官，董事总经理。

仇秉则先生，固定收益研究部总监。CFA，CPA，中山大学经济学学士，14年证券、基金行业从业经历，曾任普华永道中天会计师事务所审计经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016年6月加入汇安基金管理有限责任公司，现任固定收益研究部总监一职，从事信用债投资研究工作。

窦星华先生，常务副总经理。（简历请参见高级管理人员成员）。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：兴业证券股份有限公司（简称：兴业证券）

注册地址：福建省福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔 11 楼

法定代表人：杨华辉

成立日期：2000 年 05 月 19 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：669667.167400 万人民币

存续期间：长期

批准设立机关和批准设立文号：证监机构字【2000】52 号

基金托管业务批准文号：证监许可【2014】1170 号

联系人：汪浩

电话：021-20370656

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；证券投资基金托管业务。为期货公司提供中间介绍业务；互联网信息服务不含新闻、出版、教育、医疗保健、药品和医疗器械等内容及电子公告服务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

2、主要人员情况

杨华辉先生，男，1966 年 2 月出生，经济学博士，高级经济师。曾任兴业银行上海分行党委委员、副行长，兴业银行杭州分行党委书记、行长，联华国际信托有限公司党委书记、董事长、代理总裁，兴业国际信托有限公司党委书记、董事长。现任兴业证券股份有限公司党委书记、董事长。

刘志辉先生，男，1969 年 1 月出生，硕士研究生，国际商务师。曾任福建省政府办公厅科员、副主任科员、主任科员，福建证监局机构处、上市处、稽查处主任科员、副处长、处长。现任兴业证券股份有限公司党委副书记、董事、总裁，兼任兴证（香港）金融控股有限公司董事、兴证证券资产管理有限公司执行董事、海峡股权交易中心（福建）有限公司董事长。

二、发展概况及财务状况

兴业证券股份有限公司是中国证监会核准的全国首批综合类证券公司、创新类证券公司，成立于 1991 年 5 月，1999 年改制成立兴业证券股份有限公司，2010 年 10 月，在上海证券交易所首次公开发行股票并上市（601377.SH）。公司

注册地为福建省福州市，主要股东有福建省财政厅、福建省投资开发集团有限责任公司、中国证券金融股份有限公司等。

截止 2019 年 3 月底，公司注册资本 66.97 亿元，集团总资产 1629.99 亿元，净资产 367.28 亿元，集团员工 6000 余人。公司设立 62 家境内分公司、7 家境内控股子公司、1 家境外控股子公司，5 家参股公司，业务覆盖证券、基金、期货、资产管理、直接股权投资、跨境金融等专业领域，为境内外各类客户提供全面、专业的金融产品与服务。兴业证券成立以来，始终坚持依法经营、稳健经营、文明经营。在中国特色社会主义进入新时代的新形势下，兴业证券提出了“建设一流证券金融集团”的新战略目标。明确提出要把公司建设成为具有强大资本实力，一流的风险管理能力，一流的竞争能力和盈利能力，一流的人才和优秀企业文化、科学的机制体制的证券金融集团。

三、托管业务部的部门设置及员工情况

基金托管人兴业证券股份有限公司由专门的一级部门资产托管部具体负责基金托管业务，资产托管部现有正式员工共计 61 人，部门内设产品处、托管服务处、外包服务处、稽查监督处和 PB 交易服务处，内设各处负责人均具有证券及基金从业资格，具备多年券商及基金公司相关工作经验。基金托管人针对本基金配备了经验丰富的估值核算、投资监督、资金清算及交收等人员，主要成员均为硕士研究生学历，具备多年银行、券商、基金等相关领域工作经验，具备证券及基金从业资格。团队人员从事过公募基金、证券期货经营机构私募资产管理产品、私募投资基金等多类型产品的估值核算工作，能够及时处理资金清算和交收工作，在日常工作中具备足够丰富的托管业务处理经验。

四、基金托管业务经营情况

兴业证券股份有限公司于 2014 年 11 月经中国证监会批准获取证券投资基金托管业务资格，批准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2014】1170 号。

公司始终坚持“专业化、规范化、市场化”的经营思想，坚持“稳健规范、长远发展”的经营原则，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产委托人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过几年的发展积累，兴业证券股份有限公司托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括公募基金、证券公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、基金公司专户、私募投资基金等产品在内的较为全面的托管产品类型体系。

五、基金托管人内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

兴业证券股份有限公司作为基金托管人，严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规定，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

兴业证券股份有限公司设有审计部、合规管理部、风险管理部，组织和实施公司合规及风险管理、内部控制等相关工作。定期对托管业务内部控制机制全面性、有效性进行检查、指导。资产托管部内设稽查监督处，配备专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，独立行使稽查监督职权。

3、内部控制制度及措施

兴业证券股份有限公司资产托管部已建立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，确保托管业务的规范操作，内控机制得到有效实施；相关业务人员均具备从业资格；业务管理严格实行复核、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；业务操作区域专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现系统化操作，技术系统完整、独立，最大限度防范操作风险。

4、托管人对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对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金净值信息的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资监督和检查自基金合同生效之日开始。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法规规定的行为，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，并以书面形式或相关方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

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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

一、申购、赎回业务代理机构

1、上市推荐人

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

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

网址：www.csc108.com

2、一级交易商

（1）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

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

网址：www.csc108.com

（2）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（3）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

（4）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

（5）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（6）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523

网址：www.swhysc.com

（7）中信证券股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

网址：<http://www.cs.ecitic.com/newsite/>

（8）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

客户服务电话：95548

网址：<http://sd.citics.com/>

（9）中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客户服务电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时公告。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

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：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938991

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：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真电话：021-23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

四、基金的名称

汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金。

五、基金的类型

股票型证券投资基金。。

六、基金的投资目标

本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，力求实现跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、货币市场工具、股票期权、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。

在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成分股和备选成分股的比例不低于基金资产净值的

90%，且不低于非现金基金资产的 80%。因法律法规的规定而受限的情形除外。

八、基金的投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数成分股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。当出现特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可采取其他指数投资技术进行基金投资组合的适当调整，以实现紧密跟踪标的指数的投资目标。特殊情况包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成分股流动性严重不足；（3）标的指数成分股长期停牌；（4）标的指数成分股进行配股、分红或增发等行为时；（5）标的指数编制方法发生变化；（6）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

本基金力争日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致本基金跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

2、债券投资策略

本基金基于策略性投资的需要，可投资于国债、金融债等债券，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析、信用利差状况、债券市场供求关系等因素判断未来利率变化，动态调整组合久期和债券配置结构，精选债券获取收益。

3、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证资产安全性和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

4、衍生品投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用股票期权、股指期货、

国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货、国债期货的风险收益特征及流动性，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与股票期权投资。

5、融资及转融通证券出借

在条件许可的情况下，本基金可在不改变基金既有投资目标、投资策略和风险收益特征并在充分考虑风险控制的前提下，根据相关法律法规审慎参与融资及转融通证券出借业务。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定。

随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并按规定公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为上证证券行业指数，业绩比较基准为上证证券行业指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的费用概览

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金合同生效后标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与标的指数供应商签署的指数使用许可协议的约定，从基金财产中支付。指数许可使用费自基金合同生效日起累计，累计计提的指数许可使用费取以下 A)、B) 中的孰高者：

A) 按照指数使用许可协议规定的费率，以前一日基金资产净值为基础计算并进行计提金额的累计值：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

B) 按照指数使用许可协议规定的每季度指数许可使用费收取下限。当季日均基金资产净值（日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和÷基金当季存续天数）大于人民币 5000 万元时，本基金季度指数许可使用费下限金额为 35000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算（当季指数许可使用费下限金额=35000÷当季天数×基金当季存续天数）。当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无指数许可使用费收取下限。

指数许可使用费按日计提，逐日累计至每个季季末，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 3 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费，无需召开

基金份额持有人大会审议。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

4、上述“一、基金费用的种类”中第 4-11 项费用，根据有关法律法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

章节	主要更新内容
第三部分 基金管理人	更新了基金管理人的相关信息。
第六部分 基金的募集	更新了基金的募集的相关信息。

第七部分基金合同的生效	更新了基金合同的生效的信息。
-------------	----------------

汇安基金管理有限责任公司
二〇二〇年五月二十二日