汇安沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年第2号

二零一九年八月

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

【重要提示】

1、汇安沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）由汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金通过基金转型变更而来。2018年6月6日至2018年7月1日汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，同意汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金转型为汇安沪深300指数增强型证券投资基金，其基金类别、投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、基金费用等相关事宜均发生变更；基于该等变更，汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金合同亦进行相应修改。基金份额持有人大会决议已于表决通过之日即2018年7月2日起生效。自2018年7月3日起《汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，《汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书报中国证监会备案，但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，由投资者自行负担。

4、本基金投资股指期货、国债期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

本基金投资中小企业私募债，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。当发债主体信用质量恶化时，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。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

6、本基金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（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）、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7、基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

8、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。

9、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。

10、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述50%比例的除外。

11、本招募说明书所载内容截止日为2019年7月2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）。本招募说明书已经基金托管人复核。

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
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：秦军
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：田云梦
联系电话：（010）56711600

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。21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。现任汇安基金管理有限责任公司董事长。

秦军先生，董事，总经理。19年证券、基金行业从业经验。清华大学MBA。曾任中国航空工业规划设计研究院监理部总经理助理，中合资产管理有限责任公司北京分公司总经理，嘉实基金管理有限公司总经理助理，华安基金管理有限公司副总经理，现任汇安基金管理有限责任公司总经理。

赵毅先生，董事。1992年毕业于东北财经大学工业经济专业，1999年获该校经济学硕士学位，中欧国际工商学院EMBA毕业。自1997年以来先后创办大连生威粮食集团有限公司、辽宁中稻股份有限公司、沈阳生威投资有限公司。现任大连生威控股有限公司董事长兼总经理。

盛希泰先生，独立董事。南开大学会计系研究生，北京大学EMBA，清华大学五道口金融学院EMBA，北京交通大学管理学博士。05-15三届全国青联常委兼金融界别秘书长，中央国家机关青联副主席，全国大学生创新创业联盟联席理事长，中国青年创新创业联盟会长，中国基金业协会天使专委会会员，湖畔大学保荐人，南开大学校友总会副理事长、南开北京校友会会长、南开允能商学院理事长，现任清华校友种子基金管理合伙人，阳光保险独立董事、首创股份独立董事。

李海涛先生，独立董事。1998年获美国耶鲁大学管理学院金融学博士学位。曾任密歇根大学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。

陈伟莉女士，独立董事。1984年获西南政法大学法律专业法学学士学位，2006年获得新加坡南洋理工大学工商管理专业EMBA。现任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。

2、基金管理人监事

戴樱女士，监事。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。现任汇安基金管理有限责任公司监事。

3、高级管理人员

何斌先生，董事长。（简历请参见董事会成员）

秦军先生，董事，总经理。（简历请参见董事会成员）

郭冬青先生，督察长。10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。

刘强先生，副总经理。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。

郭兆强先生，副总经理。21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。

窦星华先生，副总经理。13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高级设计经理及总经理助理，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副总经理。

王俊波先生，副总经理。14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、本基金基金经理

朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，5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。

5、投资决策委员会成员

秦军先生，董事，总经理；（简历请参见董事会成员）

钟敏棣先生，固定收益首席投资官。24年银行、基金行业从业经验。CFA，硕士。2005年4月加入嘉实基金，从事债券研究及投资组合管理工作。2008年5月加入建信基金，曾管理建信收益增强、安心保本、稳定增利、双息红利四只债券型基金，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，担任固定收益首席投资官，固定收益投资部总经理，董事总经理。

邹唯先生，首席投资官。19年证券、基金行业从业经历。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，担任首席投资官，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，13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，担任固定收益研究部总监一职，从事信用债投资研究工作。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
成立时间：1992年10月19日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司
注册资本：293.52亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人：胡波
联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部，2005年更名为资产托管部，2013年更名为资产托管与养老金业务部，2016年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

（二）主要人员情况

高国富，男，1956年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止2019年6月30日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为4260.70亿元，比去年末增加1.13%。托管证券投资基金共一百五十四只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰18个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宣投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快钱货币基金、鹏华REITs封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈18个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞3个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证500指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰6个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业4.0主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑞泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安沛债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债3-5年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沣中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、北添富中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债3-5年国开行债券指数基金等。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、基金托管人内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和基金托管人规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、基金托管人内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备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责。

3、内部控制制度及措施：基金托管人已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

（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

1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

（1）《中华人民共和国证券法》；
（2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
（3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；；
（4）《证券投资基金销售管理办法》
（5）《基金合同》、《基金托管协议》；
（6）法律、法规、政策的其他规定。

2、监督内容

基金托管人根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

4、监督结果的处理方式

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

（2）若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人对违规事项未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

（3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

汇安基金管理有限责任公司直销中心
传真：021-80219047
邮箱：DS@huianfund.cn
北京办公地址：北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层
联系人：田云梦
电话：010-56711624
上海办公地址：上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36楼02、03单元
联系人：于擎明
电话：021-80219027

2、其他销售机构

（1）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：李建红
客服电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（2）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：刘连舸(代)
客户服务电话：95566
网址：http://www.boc.cn/

（3）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
客户服务电话：95528
网址：https://www.spdb.com.cn

（4）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
法定代表人：其实
客户服务电话：95021/400-1818-188

（5）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
法定代表人：杨文斌
客服电话：400-700-9665
网址：www.howbuy.com

（6）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路1号903室
法定代表人：凌顺平
客户服务电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com

（7）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
法定代表人：燕斌
网址：www.66zichan.com
客服电话：400-166-6788

（8）嘉实财富管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人：赵学军
客服电话：400-021-8850
网址：https://www.harvestwm.cn/

（9）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路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
注册时间：2014年9月23日
联系人：吴鸿飞
联系方式：021-6537-0077
传真：021-5508-5991
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn

（10）中泰证券股份有限公司
注册地址：济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
客服热线：95538
网址：www.zts.com.cn

（11）万联证券股份有限公司
办公地址：广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层
法定代表人：张建军
联系人：甘蕾
传真：020-38286930
客服电话：4008888133
公司官网：www.wlzq.cn

（12）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（13）扬州国信嘉利基金销售有限公司
客服电话：400-021-6088
网址：https://www.gxjlcn.com/

（14）北京蛋卷基金销售有限公司
客服电话：400-159-9288
网址：https://danjuanapp

（15）上海中正达广基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
客户服务电话：400-6767-523
网址：http://www.zzwealth.cn/

（16）阳光人寿保险股份有限公司
办公地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场1层
法定代表人：李科
客服电话：95510

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

（二）登记机构

名称：汇安基金管理有限责任公司
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：秦军
电话：010-56711600
传真：010-56711640
联系人：刚晨升

（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：张青萌
经办注册会计师：薛竞、赵钰

四、基金的名称

汇安沪深300指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深300指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越沪深300指数的投资收益和基金财产的长期增值。

七、基金的投资内容

本基金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（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）、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

本基金为增强型股票指数基金，在目标指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。

1、资产配置策略

本基金主要投资于沪深300指数成分股及备选成分股。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%。此外，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将在严格控制风险的基础上适度投资于债券、货币市场工具、股指期货及其他金融工具。

2、股票投资策略

（1）量化选股模型

本基金采用基金管理人量化团队自主开发的量化选股模型，主要选取估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析确定各因子的权重，对股票池中的股票进行综合打分后，构建股票投资组合。在此基础上，本基金进一步根据个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况，对行业内的个股权重进行动态调整，以保证股票组合的跟踪误差处于可控范围内。股票池包括标的指数的成分股及备选股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成分股中流动性良好、基本面优质及与成分股相关度高的股票。

（2）投资组合调整与风险控制

本基金将定期调整投资组合，并会对标的指数成分股保持密切跟踪。在出现因增发、送配、长期停牌后复牌等对成分股在标的指数中权重有影响的情况，或者成分股临时调入调出、成分股出现黑天鹅事件等情况时，本基金将及时对投资组合进行调整。

本基金将通过风险评估模型控制投资组合的跟踪偏离风险。本基金主要采用“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。本基金对标的指数的跟踪目标为：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。

（3）模型的动态调整与优化

基金管理人会根据市场变化趋势，综合考虑预期回报、投资风险及交易成本等因素定期对量化模型进行动态调整，不断改进量化模型的有效性，实现风险调整后的收益最大化。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，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、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

4、中小企业私募债投资策略

本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。

5、资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的。基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

7、国债期货投资策略

本基金参与国债期货交易以套期保值为目的。在风险可控的前提下，通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。具体而言，本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上，将审慎地获取相应的超额收益，通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加，以及国债期货与债券的多空比例调整，获取组合的稳定收益。

8、权证投资策略

本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合：

本基金采取现金套利策略，兑现部分标的证券的投资收益，并通过购买该证券认购权证的方式，保留未来股票上涨所带来的获利空间。

根据权证与标的证券的内在价值联系，合理配置权证与标的证券的投资比例，构建权证与标的证券的避险组合，控制投资组合的下跌风险。同时，本基金积极发现可能存在的套利机会，构建权证与标的证券的套利组合，获取较高的投资收益。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

本基金的标的指数为沪深300指数。沪深300指数由中证指数有限公司编制和发布，由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成，以综合反映沪深A股市场整体表现。如果指数编制单位变更或停止沪深300指数的编制、发布或授权，或沪深300指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致沪深300指数不宜继续作为标的指数，或者今后法律法规发生变化，证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，按监管部门要求履行适当程序以后变更标的指数、业绩比较基准、基金名称等并及时公告。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则该等变更无须召开基金份额持有人大