华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)

(2020年第1号)

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
二〇二〇年三月

重要提示

华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金(以下简称"本基金")由华安基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")依照有关法律法规及约定发起,并经中国证券监督管理委员会2015年11月19日《关于准予华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]2668号)准予注册。本基金的基金合同和招募说明书已通过指定媒介进行了公开披露。本基金的基金合同自2016年12月14日正式生效。

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。

证券投资基金(以下简称"基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险,包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、资产配置风险、技术风险、道德风险、合规风险、不可抗力风险等。此外,本基金的投资范围中包括中小企业私募债券和股指期货,可能增加本基金总体风险水平。

基金资产投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票,基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金为混合型基金,其风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩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,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金,基金销售机构名单详见基金管理人网站公示名单。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。本次招募说明书摘要仅根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及本基金的《基金合同》、《托管协议》,对所涉章节进行了更新,相关信息更新截止日为2020年2月28日。除特别说明外,本招募说明书摘要其他所载内容截止日为2019年6月14日,有关财务数据的截止日为2019年3月31日,净值表现的截止日为2018年12月31日。

一、基金名称

本基金的名称:华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金。

二、基金的类型

本基金为混合型证券投资基金。运作方式契约型开放式。存续期限不定期。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况
1、名称:华安基金管理有限公司
2、住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
3、办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
4、法定代表人:朱学华
5、设立日期:1998年6月4日
6、批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]20号
7、联系电话:(021)38969999
8、联系人:王艳
9、客户服务中心电话:40088-50099
10、网址:www.huaan.com.cn
(二)注册资本和股权结构
1、注册资本:1.5亿元人民币
2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

(三)主要人员情况
1、基金管理人董事、监事、高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。
(1)董事会

朱学华先生,本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生,博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限责任公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生,本科学历,高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记,上海东风机械(集团)公司总裁助理、副总裁,上海全光网络科技股份有限公司总经理,上海赛事商务有限公司总经理,上海东浩工艺品股份有限公司董事长,上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事,上海建筑材料(集团)总公司党委书记、董事长(法定代表人)、总裁。现任上海工业投资(集团)有限公司党委副书记、执行董事(法定代表人)、总裁。

马名驹先生,工商管理硕士,高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理,上海东方上市企业博览中心副总经理,锦江国际(集团)有限公司计划财务部经理。现任锦江国际(集团)有限公司副总裁兼金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资产管理有限公司监事。

聂小刚先生,经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副总经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁、国泰君安证券股份有限公司战略投资部总经理、权益投资部总经理、战略管理部总经理等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略投资及直投业务委员会副总裁、战略管理部总经理、国泰君安证裕投资有限公司董事长、总经理、中国证券业协会投资业务委员会副主任委员。

夏则炎先生,本科学历。历任国泰证券有限公司基金管理部业务员、交易部业务员、业务管理部项目经理、管理部综合处副经理;国泰君安证券股份有限公司经纪业务部副经理、董事会办公室副经理、经纪业务总部总经理、营销管理总部经理、上海福山路营业部副总经理(主持工作)、上海福山路营业部总经理、上海分公司副总经理、经纪业务委员会综合管理组副组长、经纪业务委员会执行办公室主任、零售业务部总经理。现任国泰君安证券销售交易部总经理。

独立董事:

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生,研究生学历,教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任,教授、博士生导师,中国工业经济学会副会长,财政部会计准则委员会咨询专家,财政部企业内部控制标准委员会委员,香港中文大学名誉教授,复旦大学管理学院兼职教授,上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

(2)监事会

张志红女士,经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务,长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会主任委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员,国泰君安证券股份有限公司总裁助理、业务总监、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司合规总监,华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生,硕士。曾任怡安翰威特咨询业务总监,麦理根(McLagan)公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司总经理助理兼人力资源部高级总监,华安资产管理(香港)有限公司董事。

诸慧女士,研究生学历,经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员,集中交易部总监。现任华安基金管理有限公司集中交易部高级总监。

(3)高级管理人员

朱学华先生,本科学历,20年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋,上海财政证券有限公司党总支副书记,上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席,兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生,博士研究生学历,17年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理,上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理(主持工作),上投摩根基金管理有限责任公司副总经理,上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任,华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士,硕士研究生学历,18年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授,中国证监会上海证管办机构处副处长,中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生,硕士研究生学历,24年金融、证券、基金行业从业经历。历任台湾富邦银行资深领组,台湾JP摩根证券投资经理,台湾摩根投信基金经理,台湾中信证券自营部协理,台湾保德信投信基金经理,华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生,硕士研究生学历,15年金融、基金行业从业经历。历任香港恒生银行上海分行交易员,华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理,华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士,硕士研究生学历,19年金融、基金行业从业经历。历任广发银行客户经理,京华山一国际(香港)有限公司高级经理,华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

2、本基金基金经理

孙晨进先生,硕士研究生,8年基金行业从业经验,具有基金从业资格证书。2010年应届毕业进入华安基金,先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015年3月至2019年1月,担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019年1月起,同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2015年3月至2015年12月,同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任本基金的基金经理。2017年1月起,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起,同时担任华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。

历任基金经理:

牛勇先生,自2016年12月14日至2018年1月15日担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度,公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下:
童威先生,总经理
翁启森先生,副总经理、首席投资官
杨明先生,投资研究部高级总监
许之彦先生,总经理助理、指数与量化投资部高级总监
贺涛先生,固定收益部总监
苏圻涵先生,全球投资部副总监
万建军先生,投资研究部联席总监
崔莹先生,基金投资部助理总监
上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况:

截至2019年6月30日,公司目前共有员工358人(不含香港公司),其中57.5%具有硕士及以上学位,92.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历,具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

四、基金托管人

(一)托管人基本情况
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:32,479,411.7万元人民币
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之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《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(ISAE3402)认证,表明了独立公正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年连续获得上海清算所授予的"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。

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3月31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440只。

五、相关服务机构

一、基金份额发售机构
1、直销机构
(1)华安基金管理有限公司上海业务部
地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31层
电话:(021)38969973
传真:(021)58406138
联系人:姚佳岑
(2)华安基金管理有限公司北京分公司
地址:北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室
电话:(010)57635999
传真:(010)66214061
联系人:刘雯
(3)华安基金管理有限公司广州分公司
地址:广州市天河区珠江西路8号高德置地夏广场D座504单元
电话:(020)38082891
传真:(020)38082079
联系人:林承壮
(4)华安基金管理有限公司西安分公司
地址:陕西省西安市高新区唐延路35号旺座现代城H座2503
电话:(029)87651812
传真:(029)87651820
联系人:赵安平
(5)华安基金管理有限公司成都分公司
地址:成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L
电话:(028)85268583
传真:(028)85268827
联系人:张晓帆
(6)华安基金管理有限公司沈阳业务部
地址:沈阳市沈河区北站路59号财富中心E座2103室
电话:(024)22522733
传真:(024)22521633
联系人:杨贺
(7)华安基金管理有限公司电子交易平台
华安电子交易网站:www.huaan.com.cn
智能手机APP平台:iPhone交易客户端、Android交易客户端
华安电子交易热线:40088-50099
传真电话:(021)33626962
联系人:谢伯恩
2、代销机构
(1)中国农业银行股份有限公司
注册地址: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
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com
(2)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn
(3)平安银行股份有限公司
注册地址:中国深圳市深南中路5047号
法定代表人:谢永林
客户服务电话:95511
网址:bank.pingan.com
(4)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
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com
(5)宏信证券有限责任公司
法定代表人:吴玉明
注册地址:四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
办公地址:四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
客户服务电话:4008-366-366
网址:www.hxzq.cn
(6)广州证券股份有限公司
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
办公地址: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:邱三发
客户服务电话:020-83963933
网址: www.gzs.com.cn
(7)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
客户服务电话:95525
网站:www.ebscn.com
(8)奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115、1116、1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系电话:(0755) 89460507
传真号码:(0755) 2167 4453
(9)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室
法定代表人:杨文斌
电话:400-700-9665
网址: www.ehowbuy.com
(10)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:广州市海珠区琶洲大道1号宝利国际广场南塔12楼
法定代表人:肖雯
客户服务电话: 020-89629066
网站:www.yingmi.cn
(11)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
法定代表人:马勇
客户服务电话:4001161188
网址:https:// 8.jrj.com/
(12) 华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市江东中路228号
办公地址:江苏省南京市江东中路228号
法定代表人:周易
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
(13)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:胡学勤
客服电话:4008219031
网址:https://www.lufunds.com
(14)上海中正达广基金销售有限公司
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: www.zzwealth.cn
(15)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
客户服务电话: 4000676266
网址: www.leadbank.com.cn
(16)北京虹点基金销售有限公司
地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人:董浩
客户服务电话: 400-068-1176
网址: www.jimufund.com
(17)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
客户服务电话:400-820-2899。
网址: www.e-rich.com.cn
(18)上海凯石财富基金销售有限公司
地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客户服务电话: 4000 178 000
网址: www.lingxianfund.com
(19)北京广源达信基金销售有限公司
注册地址:北京是西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
联系电话:4006236060
传真号码:010-82055860
(20) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋 2楼
法定代表人:汪静波
客户服务电话:400-821-5399
网址: www.noah-fund.com
(21)北京格上富信投资顾问有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系电话:(010)65983311
传真号码:(010)65983333
(22)上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人:其实
电话:4001818188
网址: www.1234567.com.cn
(23)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
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
客户服务电话: 400-046-6788
网址: www.66zichan.com
(24) 深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
电话:4006788887
网址: www.jjmmw.com www.zlfund.cn
(25)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
办公地址: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:021-96250500
网址: www.swhysc.com
(26)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人:王连志
客户服务电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn
(27)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
客户服务电话:95553、4008888001
网址:www.htsec.com
(28)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
客户服务电话:4008918918
网址:www.shzq.com
(29)华安证券股份有限公司
注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人:章宏韬
客户服务电话:95318
网址:www.hazq.com
(30)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
(31)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号18、19层
法定代表人:张建军
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn
(32)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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
客户服务电话:95587
网址:www.csc108.com
(33)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168 号上海银行大厦29层
法定代表人:杨德红
客户服务电话:95521
网址:www.gtja.com
(34)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦/16/17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦/16/17层
法定代表人:丁益
客户服务电话:400-6666-888
公司网站:www.cgws.com
(35)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com
(36)新时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层
法定代表人:叶顺德
客户服务电话:95321
网址:www.xsdzq.cn
(37)联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:徐刚
客服电话:0752-95564
网址:http://www.lxsec.com
(38)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
办公地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
传真:(0531)68889752
客户服务电话:95538
网址:http://www.zts.com.cn/
(39)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座6层、26层、27层及28层
法定代表人:丁学东
客户服务电话:(010)65051166
网址:www.cicc.com.cn
(40)第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
客户服务电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn
(41)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号
办公地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人:尤习贵
电话:400-8888-999
客户服务电话:95579
网址:www.cjsc.com.cn
(42)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:武汉市武昌区中南路99号武汉保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
客户服务电话:028-86712334
网址:www.tfzq.com
(43)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦法定代表人:赵俊
客户服务电话:95531
网址:www.longone.com.cn
(44)太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
办公地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
法定代表人:李长伟
客服电话:0871-68898130
网址:http://www.tpyzq.com
(45)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东楼2层
法定代表人:姜晓林
客户服务电话:95548
网址:www.zxwt.com.cn
(46)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
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
客户服务电话:0755-23835888
网址:www.cs.ecitic.com
(47)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路荣超大厦4036号16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路荣超大厦4036号16-20层
客户服务电话:95511-8
网址:stock.pingan.com
(48)华龙证券股份有限公司
注册地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
客户服务电话:0931-4890619
网址:www.hlzqgs.com
(49)深圳富济基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
客户服务电话:0755-83999913
网址: www.jinqianwo.cn
(50)北京创金启富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A
法定代表人:梁蓉
联系电话:010-66154828
传真号码:010-88067526
(51)泉州银行股份有限公司
注册地址:泉州市云鹿路3号
办公地址:泉州市云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系电话:0595-22551071
传真号码:0595-22505215
(52)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:95574
网址:www.nbcb.com.cn
(53)深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
法定代表人:赖任军
客户服务电话:400-930-0660
公司网址:www.jfzinv.com
(54)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
客户服务电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn
(55)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栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
法定代表人:陈柏青
电话:4000-766-123
网址: www.fund123.cn
(56)上海万得基金销售有限公司
地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
客户服务电话:400-821-0203
传真:021-5071 0161
(57)海银基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
法定代表人:刘惠
客户服务电话: 400-808-1016
网址: http://www.fundhaiyin.com
(58)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn
(59)东北证券股份有限公司
注册地址:吉林省长春市生态大街6666号
办公地址:吉林省长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
客户服务电话:95360
网址:www.nesc.cn
(60)华宝证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人:陈林
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhbstock.com
(61)中国工商银行股份有限公司
注册地址:中国北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:中国北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn
(62)中国银行股份有限公司
注册地址:中国北京市复兴门内大街1号
办公地址:中国北京市复兴门内大街1号
法定代表人:陈四清
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn
(63)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com
(64) 申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌市鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:北京西城区太桥大街19号
法定代表人:韩志谦
客户服务电话:4008000562
公司网址:www.swhysc.com
(65) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号证券大厦
办公地址:福州市湖东路268号证券大厦;上海市浦东新区长柳路36号丁香国际东塔21楼
法定代表人:兰荣
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn
(66) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路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国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
(67) 交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:彭纯
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(68) 华福证券有限责任公司
注册地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人:黄金琳
客户服务电话:96326
网址:www.hfzq.com.cn
(69) 广发证券股份有限公司
注册地址: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:广州市天河北路183号大都会广场5、7、10、18、19、35、36、38、39-44楼
法定代表人:孙树明
客户服务热线:95575
网址:www.gf.com.cn
(70) 上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:中国上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼
法定代表人:李秀仑
电话:962999
客户服务电话:(021)962999
网址:www.srcb.com
(71)广发银行股份有限公司
法定代表人:杨明生
注册地址:广州市越秀区东风东路713号
邮件:http://www.cgbchina.com.cn/#
客服电话:400-830-8003
手机:18620995055
(72)华林证券股份有限公司
注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
法定代表人:林立
客户服务电话:400-188-3888
公司网站:http://www.chinalions.com/
(73)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
法定代表人:林卓
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
电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com
(74)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人:江卉
电 话:4000988511/ 4000888816
传 真:010-89188000
(75)福建海峡银行股份有限公司
注册地址:福州市台江区江滨中大道358号福建海峡银行
办公地址:福州市台江区江滨中大道358号福建海峡银行
法定代表人:苏素华
联系电话:0591-87332762
传真号码:0591-87330926
(76)上海朝阳永续基金销售有限公司
办公地址:上海浦东碧波路690号4号楼2楼
法定代表人:廖冰
联系电话:021-80234888
传真号码:021-80234898
(77)贵州华阳众惠基金销售有限公司
注册地址:贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区C栋标准厂房
办公地址:贵州省贵阳市云岩区北京路9号贵州医科大学学术交流中心16楼
法定代表人:李陆军
联系电话:(0851)86909950
传真号码:(0851)86909950
(78)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
(79) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:易峥
电话:0571-88920897 4008-773-772
网址: www.5ifund.com
(80)上海通华基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
法定代表人:马刚
客户服务电话:021-61766900
网址: www.tonghuafund.cn
(81) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址:武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶捷
联系电话:(027)87006009
传真号码:(027)87006010
(82)江西正融资产管理有限公司
注册地址:江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会38栋2107室
办公地址:江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会38栋2108室
法定代表人:陆雯
联系电话:13879129841
传真号码:0791-86692502
(83)中民财富基金销售(上海)有限公司
注册地址:黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:黄浦区中山南路100号7层05单元
法定代表人:弭洪军
联系电话:021-33355333
传真号码:021-33355288
(84)杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人:陈刚
客户服务电话:0571-86655920
公司网站:https://www.cd121.com/
(85)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)
法定代表人:王翔
联系电话:021-65370077
公司网站:www.jiyufund.com.cn/
客户服务电话:400-820-5369
(86)深圳市锦安基金销售有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公室A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公室A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
法定代表人:李学东
联系电话:400-071-9888
网址:http://tz.glodann.com.cn/
(87)中信期货有限公司
地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
(88)江苏江南农村商业银行股份有限公司
住所:常州市和平中路413号
法定代表人:陆向阳
联系电话:(0519)96005
网址:http://www.jnbank.com.cn/index.html
(89)天津万家财富资产管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
法定代表人:李修辞
联系电话:13901314076
客户服务电话:010-59013825
网址: http://www.wanjiawealth.com/
(90)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809
法定代表人:戎兵
网址:http://www.yixinfund.com/
客服电话:400-6099-200
(91)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6层
法定代表人:李淑慧
客服电话:4000-555-671
网站:www.hgccpb.com
(92)深圳信诚基金销售有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
法定代表人:周文
客服:400-666-0066
网站:www.xcfunds.com
(93)喜鹊财富基金销售有限公司
住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人:陈皓
客服电话:0891-6177483
网址:http://www.xiquefund.com
(94)泛华普益基金销售有限公司
注册地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海锋
客户服务电话:4008-588-588
网址:www.puyifund.com/
(95)四川天府银行股份有限公司
住所:四川省南充市涪江路 1 号
法定代表人:黄光伟
热线电话:400-16-96869 028-96869
网址:http://www.cgnb.cn/pub/ncsh/
(96)成都华羿恒信财富投资管理有限公司
法定代表人:赵壁
注册地址: 成都市高新区天府大道中段199号棕榈国际中心1幢1单元19层4号
办公地址:成都市高新区天府大道中段199号棕榈国际中心1幢1单元19层4号
电话:400-8010-009 028-87326832
网址:http://www.huayihengxin.com/
(97)大河财富基金销售有限公司
法定代表人:王荻
住所:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
网址:http://www.urainf.com/
联系电话:0851-88235678
(98)北京电盈基金销售有限公司
法定代表人:程刚
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
电话:400-100-3391
网址:http://www.dianyingfund.com/
(99)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客户服务电话:4006-600109
网址:www.gjzq.com.cn
(100)上海有鱼基金销售有限公司
法定代表人:林琼
住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
客服电话:400-098-4800
网址:http://www.youyufund.com/
(101)北京恒天明泽基金销售有限公司
地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
客服电话:4008980618
网址:www.chtfund.com/
(102)洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司
法定代表人:任淑桢
注册地址:山东省青岛市崂山区香港东路195号9号楼701室
办公地址:山东省青岛市崂山区香港东路195号9号楼706室;北京市西什库大街31号九思文创园
客服电话:400 6706 863
网址:https://www.hongtaiwealth.com
(103)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6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
客户服务电话:4000618518
传真:010-61840699
网站:https://danjuanapp.com/
(104)厦门鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人:陈洪生
客服热线:400-918-0808
公司网址:www.xds.com.cn
(105)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1504/1505室
法定代表人:张冠宇
客服电话:400-819-9868
网址:http://www.tdyhfund.com/
(106)上海钜派钰茂基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路379号金穗大厦14楼
法定代表人:胡天翔
联系电话:021-50778395
传真号码:021-68367031
(107)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
客户服务电话:4000218850
公司网站:www.harvestwm.cn
(108)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼
法定代表人:胡燕亮
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
(109)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
联系电话:010-56075718
传真号码:010-67767615
(二)登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期31-32层
法定代表人:朱学华
电话:(021)38969999
传真:(021)33627962
联系人:赵良
客户服务中心电话:40088-50099
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:通力律师事务所
住所: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:孙睿
经办律师:黎明、孙睿
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:(021)2228 8888
传真:(021)2228 0000
联系人:蒋燕华
经办注册会计师:蒋燕华、沈熙苑

六、基金的投资目标

本基金在严格控制投资组合风险的前提下,利用公开信息,通过量化的方法,发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响的各类事件,把握投资机会,力争为投资者带来长期超额收益。

七、基金的投资方向

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、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券等)、债券回购、银行存款、权证、股指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:股票占基金资产的比例为30-95%,其中投资于事件驱动量化策略模型得到的证券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需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;权证、股指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。

事件驱动量化策略是一个针对事件性主题投资机会的量化投资体系。通过量化的方法分析特定事件对上市公司价值和股价表现的影响,寻求投资机会,获取由该事件带来的收益。本基金将事件分为不同类别。本基金根据基金合同约定的相关事件,选取事件已发生或公开信息即将发生的相关上市公司股票,进入备选股票库。本基金开发针对事件备选股票库的量化选股模型,该模型综合考虑上市公司所处行业、资产质量、成长前景、估值、盈利预期等因素,力争在严格控制风险的条件下获取长期稳定收益。本基金将定期及在市场出现剧烈波动时,对模型的有效性进行检验和更新,以顺应市场的变化。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略

本基金采取相对灵活的资产配置策略,通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置,并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中,本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的量化资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。

(二)股票投资策略

在本基金基金合同约定的投资比例范围内,本基金主要根据事件驱动量化策略模型进行投资决策,在模型投资机会较少时,用定量与定性相结合的方法构建补充投资组合。

(1)事件驱动

特定事件对上市公司价值和股价表现存在显著影响,通过分析,寻求投资机会,获取由该类事件带来的超额收益。可能对上市公司股票二级市场表现有影响的事件较多,本基金将深入研究下列事件,并将触发事件的上市公司股票纳入备选股票库。

1)并购重组事件

公司并购一般包括收购和兼并。收购一般指一家企业用现金或者有价证券购买另一家企业的股票或者资产,以获得对该企业的全部资产或者某项资产的所有权,或者对该企业的控制权。兼并指两家或者更多的独立企业,合并组成一家企业,通常由一家占优势的公司吸收一家或者多家公司。并购是企业迅速扩展生产经营规模,促进资本集中、资源优化配置,实现增长目标的重要途径。

资产重组是指企业与其他主体在资产、负债或所有者权益项目上的调整。资产重组是在资产结构上的重大调整,而且往往对公司的运营产生深远的影响,这些影响包括生产效率的提高、生产成本的降低、渠道的整合、公司管理水平的提升等多个方面。由于资产结构和运营模式的调整,发生资产重组后的公司,其未来的估值水平将会与之前的估值发生明显的改变。

本基金将重点关注上市公司并购重组所带来的投资机会,包括已经实施并购重组及公告并购重组董事会预案的,同时也关注有并购重组预期的上市公司,具体包括但不限于:a.上市公司或控股股东股权发生变化的;b.谋求行业转型或追求外延式增长的上市公司;c.大集团公司小上市公司等公司分析。

本基金将通过深入的研究,综合评估并购重组企业的行业增长前景,以及并购重组活动给上市公司带来的协同效应、价值低估和市场份额提升等,包括但不限于通过并购重组方式实现公司的经营转型、规模扩张、竞争优势和品牌价值提升、效率改善、盈利能力提高等。

综合评估并购重组公司所处行业、并购重组形式、并购重组目的、资产定价、交易总价值/注入资产评估价值、交易总价值/股票总市值、公司市值、预期盈利增速、估值等因素,优选行业前景看好、成长性高、价值低估的并购重组公司。

2)股权激励事件

股权激励包括股票期权、员工持股计划和管理层收购等多种不同的表现形式。股权激励计划以股权形式给予企业经营者一定的经济权利,使他们能够以股东的身份参与企业决策、分享利润、承担风险,从而勤勉尽责地为公司的长期发展服务。从公司管理实践来看,股权激励对于改善公司治理结构、降低代理成本、提升管理效率、增强公司凝聚力和市场竞争力起到非常积极的作用。本基金将通过对实施股权激励的公司进行分析,综合考虑公司质地和行权条件,构建组合。

3)涉及国家战略规划事件

通过公司投研团队的共同研究,确定当前时点国家层面的战略规划方向,并确定相应的股票池。

4)财务事件

财务事件指与上市公司财务报表相关的事件,包括:财报超预期、财报预报超预期、提前公布财报、财报预期数据变化等。本基金根据此类事件在历史上对股价的影响做出判断,力争事件发生后获取超额收益。

5)季节性事件

季节性事件指每年固定时点发生的影响股价的事件,包括:国庆、春节等节日事件。根据不同节日、节气上市公司股价的规律,本基金力争提前布局相关股票,获取超额收益。

6)新闻事件的界定

新闻事件指电视、报纸、网络等媒体出现与上市公司相关的新闻,包括:正面新闻、负面新闻、行业新闻等。本基金会根据新闻对上市公司的影响程度及新闻本身的价值,做出判断,力争获得投资机会。

(2)量化策略

量化策略就是利用量化的方法,进行金融市场的分析、判断和交易的策略、算法的总称。本基金对以上事件长期研究、监控,将触发以上事件的股票纳入备选股票库。

本基金针对上述备选股票库,建立了量化选股模型。该模型综合考虑上市公司所处行业、资产质量、成长前景、估值、盈利预期等因素,并定期及在市场出现剧烈波动时,对模型的有效性进行检验和更新,以顺应市场的变化。本基金力争事件发生后,能快速的判断决策,追求在严格控制风险的前提下获取超额收益。

(3)个股投资策略

本基金在事件驱动量化策略模型投资机会较少时,用定量与定性相结合的方法构建补充投资组合。

定量的方法主要是通过多因子选股模型,选股因子包括价值、成长、交易、财务等大类因子。定性的方法主要是,由投资管理人根据调研与研究,对公司事件的影响、个股投资价值、核心竞争力、主营业务成长性、公司治理结构、经营管理能力、商业模式等综合分析后确定投资目标。

(三)固定收益投资策略

本基金可投资于国债、金融债、企业债、可转换债券、中期票据和中小企业私募债等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于各类债券产品的比例,构造债券组合。

在选择利率债品种时,本产品将重点分析利率债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的利率债券组合;在选择信用债品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的信用资质,信用资质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约、担保记录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例,捕捉其套利机会。

(四)股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型(多头套期保值或空头套期保值),并根据风险资产投资(或拟投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例;其次,本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种和选择,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

(五)权证投资策略

本基金在实现权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较为稳定的收益。

(六)资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:75%×中证800指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。

由于本基金为混合型基金,投资组合中股票占基金资产的比例为30-95%,其中投资于事件驱动量化策略模型得到的证券的比例不低于非现金基金资产的80%。除此之外,将投资一定比例的债券。根据本基金的投资范围和投资比例,设定本基金的业绩比较基准为"75%×中证800指数收益率+25%×中国债券总指数收益率",该基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报按照监管部门要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	38,082,369.41	73.21
	其中:股票	38,082,369.41	73.21
2	固定收益投资	144,431.10	0.28
	其中:债券	144,431.10	0.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,735,720.15	26.40
7	其他资产	58,484.55	0.11
8	合计	52,021,005.21	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,482,291.00	2.91
C	制造业	21,520,158.76	42.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	983,314.00	1.93
E	建筑业	1,002,287.00	1.96
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,648,908.00	3.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,939,544.00	5.76
J	金融业	4,999,161.65	9.80
K	房地产业	1,683,043.00	3.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	746,263.00	1.46
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	520,200.00	1.02
R	文化、体育和娱乐业	557,199.00	1.09
S	综合	-	-
	合计	38,082,369.41	74.66

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600801	华新水泥	61,500	1,408,350.00	2.76
2	600031	三一重工	91,700	1,171,926.00	2.30
3	000063	中兴通讯	38,300	1,118,360.00	2.19
4	601005	重庆钢铁	469,800	1,028,862.00	2.02
5	600219	南山铝业	382,628	1,021,616.76	2.00
6	600623	华谊集团	105,600	994,752.00	1.95
7	600038	中直股份	20,500	958,375.00	1.88
8	300130	新国都	52,800	919,248.00	1.80
9	600657	信达地产	154,900	865,891.00	1.70
10	300326	凯利泰	74,300	828,445.00	1.62

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	144,431.10	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	144,431.10	0.28

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110051	中天转债	690	76,031.10	0.15
2	113529	绝味转债	300	30,000.00	0.06
3	128061	启明转债	194	19,400.00	0.04
4	110056	亨通转债	190	19,000.00	0.04

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本基金投资国债期货的投资政策
根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
10.3 本基金投资国债期货的投资评价
无。
11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,709.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,657.27
5	应收申购款	1,117.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,484.55

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金净值表现

历史各时间段基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较(截至时间2018年12月31日)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效(2016年12月14日)起至2016年12月31日	0.10%	0.06%	-1.51%	0.36%	1.61%	-0.30%
2017年1月1日至2017年12月31日	-0.60%	0.78%	10.31%	0.49%	-10.91%	0.29%
2018年1月1日至2018年12月31日	-31.16%	1.48%	-19.00%	1.00%	-12.16%	0.48%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用
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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.50%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人于次月前3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、公休假等,支付日期顺延。

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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

除基金管理费、基金托管费之外的基金费用,根据有关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。

(二)与基金销售有关的费用
1、申购费用

本基金对通过直销机构申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的申购费率。通过直销机构申购本基金的养老金客户申购费率为每笔500元。其他投资人申购本基金的申购费率随申购金额的增加而递减;投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下表所示:

单笔申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<300万	1.20%
300万≤M<500万	0.80%
M≥500万	每笔1000元

申购费用在投资人申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费用
本基金的赎回费率随申请份额持有时间的增加而递减,具体费率如下表所示:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<30天	0.75%
30天≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注:1年指365天,2年为730天

赎回费用由赎回本基金基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于6个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金转换份额的计算
基金转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费。
转出基金赎回费=转出份额×转出基金当日基金份额净值×转出基金赎回费率
转出金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值-转出基金赎回费
基金转换申购补差费按转入与转出基金之间申购费的差额计算收取,具体计算公式如下:
基金转换申购补差费= max[(转入基金的申购费-转出基金的申购费),0],即转入基金申购费减去转出基金申购费,如为负数则取0
转入金额 = 转出金额—基金转换申购补差费
转入份额 = 转入金额÷转入基金当日基金份额净值
转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。
其中:
转入基金的申购费=[转出金额-转出金额÷(1+转入基金的申购费率)] 或转入基金固定收费金额
转出基金的申购费=[转出金额-转出金额÷(1+转出基金的申购费率)] 或转出基金固定收费金额
注1:转入份额的计算结果四舍五入,保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产。
注2:本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务。
注3:关于转换费用的其他相关条款请详见公司网站的有关临时公告。

4、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(三)其他费用
1、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
2、《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;
3、基金份额持有人大会费用;
4、基金的证券、期货交易费用;
5、基金的银行汇划费用;
6、基金的开户费用、账户维护费用;
7、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。
上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(四)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。

(五)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒介上刊登公告。

(六)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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他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:

本次基金管理人根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》以及本基金的《基金合同》、《托管协议》,更新了招募说明书的重要提示、绪言、释义、基金管理人、基金份额的申购、赎回与转换、基金资产的估值、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、基金合同的变更、终止与基金财产的清算、基金合同内容摘要、基金托管协议内容摘要、招募说明书存放及查阅方式等相应的内容,详见更新的招募说明书。

华安基金管理有限公司
二〇二〇年三月七日